

Auflösungsbericht zum 14. Dezember 2016

Quant.Euro Long Variable

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Quant.Euro Long Variable

in der Zeit vom 01. Januar 2016 bis 14. Dezember 2016.

Hamburg, im März 2017

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

Nicholas Brinckmann

Marc Drießen

Dr. Jörg W. Stotz

So behalten Sie den **Überblick:**

Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr 2016	4
Vermögensaufstellung per 14. Dezember 2016	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	11
Wiedergabe des Vermerks des Abschlussprüfers	12
Besteuerung der Wiederanlage	13
Bescheinigung nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 InvStG	14
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	16

Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr 2016

Anlageziel und Anlagepolitik

Ziel des Quant.Euro Long Variable ist es, auf Jahressicht positive Erträge zu erzielen und gleichzeitig gegenüber dem DJ EuroStoxx 50 Index eine höhere Rendite zu erreichen.

Das Fondsmanagement beabsichtigt, eine quantitative Anlagestrategie auf Grundlage der Aktien des DJ EuroStoxx 50 Index (optional dividendenstarker Large Cap-Aktien mit hoher Korrelation zum DJ EuroStoxx 50 Index) sowie standardisierten Euro Stoxx 50 Index-Futures-Kontrakten (optional DAX30 Index-Futures- und FTSE100 Index-Futures-Kontrakten) zu verfolgen. Im Basisportfolio wird zu mind. 75 % des Nettoinventarwertes (NAV) des Fonds fortlaufend in Kassa-Aktien des Euro Stoxx 50 Index investiert. Der Investitionsgrad des Fonds wird durch den Einsatz von Euro Stoxx 50 Index-Futures variabel zwischen 0 % und + 100 % des NAV gesteuert. Die Umsetzung erfolgt dabei durch einen Kauf ("Long") oder Verkaufs- (Short") Ansatz der Futures-Kontrakte. Die Bestimmung des täglichen Investitionsgrades ermittelt das Fondsmanagement auf Basis unterschiedlicher quantitativer Strategieelemente (Mean Reversion, Regressionsverfahren, volatilitätsabhängige Verfahren und weitere).

Portfoliostruktur

Im Berichtszeitraum variierte der Investitionsgrad im Investmentvermögen zwischen 0 % und 100 %. Das zugrunde liegende Aktienportfolio entsprach bezüglich der Titelselektion und -gewichtung weitestgehend dem Euro Stoxx 50 Index.

Veräußerungsergebnisse

Die ausschließlich in Euro erzielten Veräußerungsergebnisse betragen im Berichtszeitraum EUR -5.489.604,71. Sie sind das Ergebnis aus Futures-Transaktionen sowie Feinabstimmungen der Aktienpositionen.

Risikoanalyse

Der Fonds erzielte im Berichtszeitraum eine Volatilität von 11,3 %.

Adressenausfallrisiken:

Das Ausfallrisiko beschränkt sich auf die Euro Stoxx 50 Index Future-Positionen. Dieses ist durch die Nutzung des integrierten Clearings eines zentralen Kontrahenten (Eurex) sehr gering.

Marktpreisrisiken:

Das zentrale Marktpreisrisiko des Investmentvermögens liegt in der Kursentwicklung des Euro Stoxx 50 Index.

Operationelle Risiken:

Besondere operationelle Risiken waren im Berichtszeitraum nicht zu verzeichnen.

Liquiditätsrisiken:

Besondere Liquiditätsrisiken waren im Berichtszeitraum nicht zu verzeichnen.

Zinsänderungsrisiken:

Besondere Zinsänderungsrisiken waren im Berichtszeitraum nicht zu verzeichnen.

Sonstige Hinweise

Die mit der Verwaltung des Investmentvermögens betraute Kapitalverwaltungsgesellschaft ist die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH, Hamburg.

Das Portfoliomanagement für den Quant. Euro Long Variable ist an die Quant. Capital Management GmbH ausgelagert. Hierbei handelt es sich um ein nicht mit der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH verbundenes Unternehmen.

Wesentliche Ereignisse

Das Investmentvermögen wurde zum 14. Dezember 2016 geschlossen.

Vermögensaufstellung per 14. Dezember 2016

Fondsvermögen: EUR 0,00 (40.480.689,07)

Umlaufende Anteile: 0 (447.200)

Vermögensübersicht zum 14.12.2016			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens VJ
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien	0,00	0,00	(85,96)
2. Derivate	0,00	0,00	(-1,13)
3. Bankguthaben	36.249.283,48	0,00	(7,02)
4. Sonstige Vermögensgegenstände	2.669.803,04	0,00	(8,22)
II. Verbindlichkeiten	-38.919.086,52	0,00	(-0,07)
III. Fondsvermögen	0,00	0,00	

(Angaben in Klammern per 31.12.2015)

Vermögensaufstellung zum 14.12.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 14.12.2016	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: State Street Bank International GmbH			EUR	36.249.283,48				36.249.283,48	0,00
Summe der Bankguthaben							EUR	36.249.283,48	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände									
Initial Margin			EUR	2.643.122,59				2.643.122,59	0,00
Dividendenansprüche			EUR	6.044,90				6.044,90	0,00
Quellensteueransprüche			EUR	20.635,55				20.635,55	0,00
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	2.669.803,04	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-38.919.086,52			EUR	-38.919.086,52	0,00
Fondsvermögen							EUR	0,00	0*)
Anteilwert							EUR	0,00	
Umlaufende Anteile							STK	0	

Fußnoten:

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

1) noch nicht abgeführte Depotgebühr, Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Transaktionsgebühren, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Zinsen lfd. Konto, Rückstellung für die Anteilseigner wg. vorzeitiger Rückgabe

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 0,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Anheuser-Busch InBev	BE0003793107	STK	1.446	13.901	
adidas	DE000A1EWW00	STK	3.300	3.300	
Ahold Delhaize N.V., Kon.	NL0011794037	STK	21.742	21.742	
Air Liquide	FR0000120073	STK	939	6.589	
Airbus Group	NL0000235190	STK	1.260	10.574	
Allianz	DE0008404005	STK	886	8.318	
Anheuser-Busch InBev	BE0974293251	STK	12.980	12.980	
ASML Holding	NL0010273215	STK	704	6.773	
AXA	FR0000120628	STK	4.014	38.021	
BASF	DE000BASF111	STK	1.674	16.634	
Bayerische Motoren Werke	DE0005190003	STK	592	5.822	
Bayer	DE000BAY0017	STK	1.576	14.970	
Banco Bilbao	ES0113211835	STK	14.053	115.129	
Bco Santander Cen. Hisp.	ES0113900J37	STK	32.840	261.149	
BNP Paribas	FR0000131104	STK	2.096	20.199	
Carrefour	FR0000120172	STK	-	10.224	
CRH	IE0001827041	STK	14.131	14.131	
Daimler	DE0007100000	STK	1.844	18.060	
Danone	FR0000120644	STK	1.320	11.050	
Deutsche Bank	DE0005140008	STK	3.814	24.950	
Deutsche Post	DE0005552004	STK	1.756	17.346	
Deutsche Telekom	DE0005557508	STK	7.058	57.387	
E.ON SE	DE000ENAG999	STK	3.696	36.238	
Enel	IT0003128367	STK	21.824	126.772	
Engie S.A.	FR0010208488	STK	2.978	29.347	
ENI	IT0003132476	STK	2.136	45.980	
Essilor Intl -Cie Génle Opt.	FR0000121667	STK	364	3.922	
Fresenius	DE0005785604	STK	898	7.248	
Assicurazioni Generali	IT0000062072	STK	2.504	24.476	
Iberdrola	ES0144580Y14	STK	9.749	103.604	
Industria de Diseño Textil	ES0148396007	STK	1.954	19.010	
ING Groep	NL0011821202	STK	69.981	69.981	
ING	NL0000303600	STK	7.304	69.981	
Intesa Sanpaolo	IT0000072618	STK	27.150	259.961	
Kon. Philips	NL0000009538	STK	2.056	17.229	
LVMH	FR0000121014	STK	474	4.871	
Münchener Rückversicherung	DE0008430026	STK	222	2.734	
Nokia	FI0009000681	STK	38.868	98.614	
Orange	FR0000133308	STK	5.440	36.832	
L' Oréal	FR0000120321	STK	422	4.396	
Safran	FR0000073272	STK	958	6.178	
Sanofi-Aventis	FR0000120578	STK	1.936	21.506	
SAP	DE0007164600	STK	1.980	17.466	
Schneider Electric	FR0000121972	STK	1.050	10.574	

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Siemens	DE0007236101	STK	1.252	14.020	
Compagnie de Saint-Gobain	FR0000125007	STK	866	9.031	
Société Générale	FR0000130809	STK	1.536	14.614	
Telefónica	ES0178430E18	STK	7.418	77.941	
Total S.A.	FR0000120271	STK	5.310	44.079	
UniCredit	IT0004781412	STK	17.596	108.001	
Unilever	NL0000009355	STK	2.954	28.277	
VINCI	FR0000125486	STK	1.622	10.100	
Vivendi	FR0000127771	STK	322	21.148	
Volkswagen Vorzugsaktien	DE0007664039	STK	816	3.328	
Andere Wertpapiere					
Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl. Anrechte	FR0013201381	STK	6.178	6.178	
Banco Santander Anrechte	ES061390904	STK	243.482	243.482	
Iberdrola Anrechte	ES06445809B3	STK	93.855	93.855	
Iberdrola Anrechte	ES06445809C1	STK	103.604	103.604	
Telefónica Anrechte	ES06784309B3	STK	77.941	77.941	
Unibail-Rodamco	FR0000124711	STK	212	1.782	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Aktien					
Uniper	DE000UNSE018	STK	3.624	3.624	
Andere Wertpapiere					
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Anrechte	ES06132119C3	STK	115.129	115.129	
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Anrechte	ES06132119D1	STK	109.066	109.066	
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
Basiswert: DJES 50 Index (Price) (EUR)		EUR			27.588,53
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: DJES 50 Index (Price) (EUR)		EUR			625.791,06

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

für den Zeitraum vom 01. Januar 2016 bis 14. Dezember 2016

I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller	EUR	286.159,01
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	EUR	899.186,07
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	-16.893,33*)
4. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR	-75.903,67
5. Sonstige Erträge 1)	EUR	18.471,20
Summe der Erträge	EUR	1.111.019,28
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR	-3.879,22
2. Verwaltungsvergütung	EUR	-186.066,99
3. Verwahrstellenvergütung	EUR	-14.280,00
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR	-8.337,61
5. Sonstige Aufwendungen 2)	EUR	-8.212,19
Summe der Aufwendungen	EUR	-220.776,01
III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	890.243,27
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	EUR	8.531.319,88
2. Realisierte Verluste	EUR	-14.020.924,59
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	-5.489.604,71
V. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	-4.599.361,44
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	-783.304,81
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	3.995.674,39
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	3.212.369,58
VII. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	-1.386.991,86

*) Der Sollsaldo resultiert aus negativen Habenzinsen

Entwicklung des Sondervermögens

	2016	
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	40.480.689,07
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR	-536.640,00*)
2. Mittelzufluss / -abfluss (netto)	EUR	-38.557.057,21
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen:	EUR	0,00
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen:	EUR	-38.557.057,21
3. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	-1.386.991,86
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	-783.304,81
davon nicht realisierte Verluste	EUR	3.995.674,39
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	0,00

*) Aufgrund der Auflösung wird zusätzlich zum Geschäftsjahr 2015 auch der Steuerabzug für das aktuelle Rumpfgeschäftsjahr i.H.v. EUR 290.680,00 ausgewiesen

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Wiederanlage	insgesamt	je Anteil *) **)
I. Für die Wiederanlage verfügbar		
1. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR -4.599.361,44	0,00
2. Zuführung aus dem Sondervermögen ***)	EUR 14.020.924,59	0,00
3. Zur Verfügung gestellter Steuerabzugsbetrag	EUR -290.680,00	0,00
II. Wiederanlage	EUR 9.130.883,15	0,00

*) Pflichtangabe gem. § 101 Abs. 1 Nr. 5 KAGB

**) bei Anteilklassen ist die Berechnung der Wiederanlage ggf. für jede Anteilklasse gesondert vorzunehmen.

***) Die Zuführung aus dem Sondervermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten

Für die Ermittlung der investmentsteuerlichen Besteuerungsgrundlagen wird eine Bescheinigung nach §5 InvStG erstellt.

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert	
Auflage			EUR	100,00
31.12.2015	EUR	40.480.689,07	EUR	90,52
14.12.2016	EUR	0,00	EUR	0,00

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 0,00

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Interactive Brokers
Royal Bk of Scotld
State Street Bank International GmbH

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 0,00
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 0,00

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

Sonstige Angaben

Anteilwert EUR 0,00
Umlaufende Anteile STK 0

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

Gesamtkostenquote *) 0,56 %
Transaktionskosten**) EUR 133.213,24

*) Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus

**) Transaktionskosten: Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

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

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen:

- 1) Im Wesentlichen Quellensteuererstattungen, Dividendenerträge (REITS)
- 2) Im Wesentlichen Depotgebühren, Kosten für die Marktrisikomessung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nicht realisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nicht realisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Hamburg, 24. Februar 2017

HANSAINVEST
Hanseatische Investment-GmbH
Geschäftsführung

(Nicholas Brinckmann) (Marc Drießen) (Dr. Jörg W. Stotz)

Wiedergabe des Vermerks des Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft mit beschränkter Haftung, Hamburg

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft mit beschränkter Haftung hat uns beauftragt, gemäß § 105 Abs. 3 des Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) den Auflösungsbericht des Investmentvermögens Quant.Euro Long Variable für den Zeitraum vom 1. Januar 2016 bis 14. Dezember 2016 zu prüfen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter

Die Aufstellung des Auflösungsberichts nach den Vorschriften des KAGB liegt in der Verantwortung der gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft.

Verantwortung des Abschlussprüfers

Unsere Aufgabe ist es, auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfung eine Beurteilung über den Auflösungsbericht abzugeben.

Wir haben unsere Prüfung nach § 105 Abs. 3 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung vorgenommen. Danach ist die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass Unrichtigkeiten und Verstöße, die sich auf den Auflösungsbericht wesentlich auswirken, mit hinreichender Sicherheit erkannt werden. Bei der Festlegung der Prüfungshandlungen werden die Kenntnisse über die Verwaltung des Investmentvermögens sowie die Erwartungen über mögliche Fehler berücksichtigt. Im Rahmen der Prüfung werden die Wirksamkeit des rechnungslegungsbezogenen internen Kontrollsystems und die Nachweise für die Angaben im Auflösungsbericht überwiegend auf der Basis von Stichproben beurteilt. Die Prüfung umfasst die Beurteilung der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze für den Auflösungsbericht und der wesentlichen Einschätzungen der gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine hinreichend sichere Grundlage für unsere Beurteilung bildet.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der Auflösungsbericht für den Zeitraum vom 1. Januar 2016 bis 14. Dezember 2016 den gesetzlichen Vorschriften.

Hamburg, den 27. Februar 2017

PricewaterhouseCoopers
Aktiengesellschaft
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Lothar Schreiber ppa. Christoph Wappler
Wirtschaftsprüfer Wirtschaftsprüfer

Besteuerung der Wiederanlage

HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

Besteuerungsgrundlagen gemäß § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und Nr. 2 InvStG

Geschäftsjahr vom 01.01.2016 bis 14.12.2016

Steuerlicher Zufluss: 14.12.2016

Name des Investmentfonds: Quant.Euro Long Variable EB

ISIN: DE000A12BKC3

§ 5 Abs. 1 S. 1 Nr. InvStG		Privatvermögen EUR je Anteil	Betriebsvermögen KStG ¹⁾ EUR je Anteil	Sonst. Betriebsvermögen ²⁾ EUR je Anteil
2)	Betrag der Thesaurierung/ ausschüttungsgleichen Erträge	2,4286780	2,4286780	2,4286780
1 c)	In der Thesaurierung enthaltene			
	aa) Erträge i.S.d. § 2 Abs. 2 S. 1 i.V.m. § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG ⁴⁾	-	-	2,4286780
	cc) Erträge i.S.d. § 2 Abs. 2a (Zinsschranke)	-	0,0000000	0,0000000
	gg) Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 1	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	hh) in 1 c gg) enthaltene Einkünfte, die nicht dem Progressionsvorbehalt unterliegen	0,0000000	-	0,0000000
	ii) Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2, auf die tatsächlich ausländische Quellensteuer einbehalten wurde oder als einbehalten gilt, für die kein Abzug nach Abs. 4 vorgenommen wurde	0,7439496	0,7439496	0,7439496
	jj) in 1 c ii) enthaltene Einkünfte, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,7439496
	kk) in 1 c ii) enthaltene Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2, die nach einem DBA zur Anrechnung einer als gezahlt geltenden Steuer auf die Einkommensteuer oder Körperschaftsteuer berechnen	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	ll) in 1 c kk) enthaltene Einkünfte, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0000000
1 d)	zur Anrechnung von Kapitalertragsteuer berechtigender Teil der Erträge			
	aa) i.S.d. § 7 Abs. 1 und 2	1,9197692	1,9197692	1,9197692
	bb) i.S.d. § 7 Abs. 3	0,5089088	0,5089088	0,5089088
	davon inländische Mieterträge	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	cc) i.S.d. § 7 Abs. 1 S. 4, soweit in 1 d aa) enthalten	1,9197692	1,9197692	1,9197692
1 f)	Betrag der ausländischen Steuer, der auf die in den Erträgen enthaltenen Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2 entfällt, und			
	aa) der nach § 4 Abs. 2 i.V.m. § 32d Abs. 5 oder § 34c Abs. 1 EStG oder einem DBA anrechenbar ist, wenn kein Abzug nach § 4 Abs. 4 vorgenommen wurde ⁵⁾	0,0985387	0,0985387	0,0985387
	bb) in 1 f aa) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0985387
	cc) der nach § 4 Abs. 2 i.V.m. § 34c Abs. 3 EStG abziehbar ist, wenn kein Abzug nach § 4 Abs. 4 vorgenommen wurde	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	dd) in 1 f cc) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0000000
	ee) der nach einem DBA als gezahlt gilt und nach § 4 Abs. 2 i.V.m. diesem Abkommen anrechenbar ist ⁵⁾	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	ff) in 1 f ee) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0000000
1 g)	Betrag der Absetzungen für Abnutzung oder Substanzverringerung	0,0000000	0,0000000	0,0000000
1 h)	die im Geschäftsjahr gezahlte Quellensteuer, vermindert um die erstattete Quellensteuer des Geschäftsjahres oder früherer Geschäftsjahre ⁶⁾	0,1667344	0,1667344	0,1667344

Steuerlicher Anhang:

- Angaben für Anleger, die nach dem KStG besteuert werden. Bei den Angaben ist zu beachten, dass § 8b Abs. 1 bis 6 KStG für Anleger, die bestimmte Körperschaften sind, keine Anwendung findet. Die Anwendbarkeit vorgenannter Vorschriften kann auch Einfluss auf die Anrechenbarkeit ausländischer Quellensteuern haben.
- Angaben für Anleger, die ihre Anteile im Betriebsvermögen halten und nach dem EStG besteuert werden (z.B. Einzelunternehmer oder Mitunternehmer in gewerblichen Personengesellschaften).
- N.A.
- Die Einkünfte sind zu 100 % ausgewiesen.
- Der Ausweis der ausländischen anrechenbaren (fiktiven) Quellensteuer erfolgt beim Privatanleger unter Beachtung der Höchstbetragsberechnung.
- Der Ausweis der gezahlten Quellensteuer des aktuellen Geschäftsjahres vermindert um die erstattete Quellensteuer aus Vorjahren nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 h) InvStG erfolgt unter Berücksichtigung der auf Fondsebene bereits nach § 4 Abs. 4 InvStG als Werbungskosten abgezogenen anrechenbaren ausländischen Quellensteuer. Soweit die erstattete Quellensteuer die gezahlte Quellensteuer übersteigt, erfolgt der Ausweis als negativer Betrag.

Bescheinigung nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 InvStG

HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

Bescheinigung über die Angaben i.S.d. § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 InvStG für den vorstehenden Investmentfonds für den genannten Zeitraum

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH (nachfolgend: die Gesellschaft):

Die Gesellschaft hat uns beauftragt, gemäß § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 Investmentsteuergesetz (InvStG) zu prüfen, ob die von der Gesellschaft für den oben genannten Investmentfonds für den genannten Zeitraum zu veröffentlichenden Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden. Die Bescheinigung hat zudem eine Aussage darüber zu enthalten, ob Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO vorliegen, der sich auf die Besteuerungsgrundlagen nach § 5 Abs. 1 InvStG oder auf die Aktiengewinne nach § 5 Abs. 2 Satz 1 InvStG auswirken kann, die für den Zeitraum veröffentlicht wurden, auf den sich die Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen.

Die Verantwortung für die Ermittlung der steuerlichen Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG in Verbindung mit den Vorschriften des deutschen Steuerrechts liegt bei den gesetzlichen Vertretern der Gesellschaft. Die Ermittlung beruht auf der Buchführung/den Aufzeichnungen und dem Jahresbericht nach § 44 Abs. 1 InvG bzw. § 101 Abs. 1 Kapitalanlagegesetzbuch (KAGB) für den betreffenden Zeitraum. Sie besteht aus einer Überleitung aufgrund steuerlicher Vorschriften und der Zusammenstellung der zur Bekanntmachung bestimmten steuerlichen Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG. In den Jahresbericht sowie

in die steuerlichen Angaben sind Werte aus einem Ertragsausgleich eingegangen. Soweit die Gesellschaft Mittel in Anteile an anderen Investmentfonds (Zielfonds) investiert hat, verwendet sie die ihr für diese Zielfonds vorliegenden steuerlichen Angaben.

Unsere Aufgabe ist es, auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfung eine Beurteilung abzugeben, ob die von der Gesellschaft nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 InvStG zu veröffentlichenden Angaben in Übereinstimmung mit den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden. Unsere Prüfung erfolgt auf der Grundlage der von einem Abschlussprüfer nach § 44 Abs. 5 InvG bzw. § 102 KAGB geprüften Buchführung/Aufzeichnungen und des geprüften Jahresberichtes. Unserer Beurteilung unterliegen die darauf beruhende Überleitung und die zur Bekanntmachung bestimmten Angaben. Unsere Prüfung erstreckt sich insbesondere auf die steuerliche Qualifikation von Kapitalanlagen, von Erträgen und Aufwendungen einschließlich deren Zuordnung als Werbungskosten sowie sonstiger steuerlicher Aufzeichnungen. Soweit die Gesellschaft Mittel in Anteile an Zielfonds investiert hat, beschränkte sich unsere Prüfung auf die korrekte Übernahme der für diese Zielfonds von anderen zur Verfügung gestellten steuerlichen Angaben durch die Gesellschaft nach Maßgabe vorliegender Bescheinigungen. Die entsprechenden steuerlichen Angaben wurden von uns nicht geprüft.

Wir haben unsere Prüfung unter sinnvoller Beachtung der vom Institut der

Wirtschaftsprüfer festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung vorgenommen. Danach ist die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass mit hinreichender Sicherheit beurteilt werden kann, ob die Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG frei von wesentlichen Fehlern sind. Bei der Festlegung der Prüfungshandlungen werden die Kenntnisse über die Verwaltung des Investmentfonds sowie die Erwartungen über mögliche Fehler berücksichtigt. Im Rahmen der Prüfung berücksichtigen wir das für die Ermittlung der Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG relevante interne Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen und durchzuführen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.

Die Prüfung umfasst auch eine Beurteilung der Auslegung der angewandten Steuergesetze durch die Gesellschaft. Die von der Gesellschaft gewählte Auslegung ist dann nicht zu beanstanden, wenn sie in vertretbarer Weise auf Gesetzesbegründungen, Rechtsprechung, einschlägige Fachliteratur und veröffentlichte Auffassungen der Finanzverwaltung gestützt werden konnte. Wir weisen darauf hin, dass eine künftige Rechtsentwicklung oder insbesondere neue Erkenntnisse aus der Rechtsprechung eine andere Beurteilung der von der Gesellschaft vertretenen Auslegung notwendig machen können.

Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine hinreichend sichere Grundlage für unsere Beurteilung bildet.

Für unsere Aussage, ob Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten, des Rechts nach § 42 AO vorliegen, der sich auf die Besteuerungsgrundlagen nach § 5 Abs. 1 InvStG auswirken kann, sind nach § 5 Abs. 1a Satz 3 InvStG keine über die Prüfung der Einhaltung der Regeln des deutschen Steuerrechts hinausgehenden Ermittlungen vorzunehmen. Für unsere Aussage, ob Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO vorliegen, der sich auf die Aktiengewinne nach § 5 Abs. 2 Satz 1 InvStG auswirken kann, die für den Zeitraum veröffentlicht wurden, auf den sich die Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen, haben wir besondere Ermittlungen nur im Hinblick auf Vorgänge des laufenden Jahres vorgenom-

men. Unsere Aussage stützen wir auf analytische Prüfungshandlungen und Befragungen zu den veröffentlichten Aktiengewinnen und den veröffentlichten Rücknahmepreisen für den Berichtszeitraum.

Auf dieser Grundlage bescheinigen wir der Gesellschaft nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 InvStG, dass die Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden.

Es haben sich keine Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO ergeben, der sich auf die Besteuerungsgrundlagen nach § 5 Abs. 1 InvStG oder auf die Aktiengewinne nach § 5 Abs. 2 Satz 1 InvStG auswirken kann, die für den Zeitraum veröffentlicht wurden, auf den sich die Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen.

Es kann nicht ausgeschlossen werden, dass sich aus Sicht der Finanzverwaltung aus den von dem Investmentfonds durchgeführten Geschäften oder sonstigen Umständen, insbesondere dem Abschluss von derivativen Geschäften, dem Kauf und Verkauf von Wertpapieren und anderen Vermögensgegenständen, dem Bezug von Leistungen, durch die Werbungskosten entstehen, der Vornahme eines Ertragsausgleichs, der Entscheidung über die Ausschüttung von Erträgen, sowie deren Zusammenspiel (weitere) Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO ergeben.

Frankfurt am Main, den 06.03.2017

KPMG AG

Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Olaf J. Mielke, MBA Eugenie Jurk

Steuerberater

Steuerberaterin

Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien

Kapitalverwaltungsgesellschaft:

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

Kunden-Servicecenter:
Telefon: (0 40) 3 00 57 - 62 96
Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70
Internet: www.hansainvest.de
E-Mail: service@hansainvest.de

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 10.500.000,-
Haftendes Eigenkapital:
€ 9.970.142,52
(Stand: 31.12.2015)

Gesellschafter:

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

Verwahrstelle:

State Street Bank International GmbH,
Frankfurt
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 109.300.000,-
Haftendes Eigenkapital:
€ 2.154.400.000,-
(Stand: 31.12.2015)

Einzahlungen:

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

Aufsichtsrat:

Martin Berger (Vorsitzender),
Vorstandsmitglied 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,
Berater der Aramea Asset
Management AG, Hamburg

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 GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft,
Hamburg

Geschäftsführung:

Nicholas Brinckmann
(zugleich Mitglied der Geschäftsführung
HANSAINVEST Real Assets GmbH)

Marc Drießen
(zugleich stellvertretender Präsident
des Verwaltungsrats der HANSAINVEST
LUX S.A.)

Dr. Jörg W. Stotz
(zugleich Präsident des Verwaltungsrats
der HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied
der Geschäftsführung der SIGNAL
IDUNA Asset Management GmbH
sowie Mitglied der Geschäftsführung
HANSAINVEST Real Assets 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 - 60 70

service@hansainvest.de
www.hansainvest.de