

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2014

Quant.El-Erian

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Quant.El-Erian

in der Zeit vom 01. Januar 2014 bis 30. Juni 2014.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von -1,60 % in der Class EB sowie von -2,33 % in der Class I.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Sondervermögens im Detail per Ende Juni 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 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, Dr. Jörg W. Stotz, Dirk Zabel

Hamburg, im Juli 2014

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensaufstellung per 30. Juni 2014	4
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	7
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	8

Vermögensaufstellung per 30. Juni 2014

Fondsvermögen: EUR 23.268.872,20 (46.504.660,54)

Umlaufende Anteile: EB Klasse: Stück 248.730 (489.260)

I Klasse: Stück 110 (110)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
Verzinsliche Wertpapiere	120	0,52	(0,00)
Derivate	6	0,03	(0,00)
Barvermögen	21.659	93,08	(91,02)
sonstige Vermögensgegenstände	1.506	6,46	(9,07)
sonstige Verbindlichkeiten	-22	-0,09	(-0,09)
	23.269	100,00	

(Angaben in Klammern per 31.12.2013)

Vermögensaufstellung zum 30.06.2014

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2014	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% - Anteil des Fonds- vermö- gens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
0,000000000% Niederlande EO-Anl. 13/16	NL0010364139		EUR	120	120	0	% 99,869000	119.842,80	0,52
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	119.842,80	0,52
Summe Wertpapiervermögen							EUR	119.842,80	0,52
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Devisen-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Devisen									
Put Devisenopt. EUR/GBP Put 14.08.2014 0,7716 0,771600000 14.08.2014	DE000FXD0227		STK	1				560,00	0,00
Put Devisenopt. EUR/USD Put 14.07.2014 1,3545 1,354500000 14.07.2014	DE000FXD0201		STK	1				8.450,00	0,04
Devisenterminkontrakte (Kauf)									
Offene Positionen									
USD/NOK 0,53 Mio.		OTC						-1.622,54	-0,01
EUR/USD 1,35 Mio.		OTC						1.276,49	0,01
USD/GBP 0,53 Mio.		OTC						-441,55	0,00
USD/CAD 0,53 Mio.		OTC						-884,27	0,00
USD/SEK 0,53 Mio.		OTC						-806,06	0,00
USD/CHF 0,53 Mio.		OTC						-272,82	0,00
Optionsrechte									
Summe der Devisen-Derivate							EUR	6.259,25	0,03
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: State Street Bank GmbH			EUR	2.254.789,35				2.254.789,35	9,69
Bank: Norddeutsche Landesbank -GZ-			EUR	4.101.272,04				4.101.272,04	17,63
Bank: Donner & Reuschel AG			EUR	4.101.105,14				4.101.105,14	17,62
Bank: Bayerische Hypo- und Vereinsbank AG			EUR	4.100.746,96				4.100.746,96	17,62
Bank: BHF-Bank AG			EUR	3.000.307,50				3.000.307,50	12,90
Bank: National-Bank AG			EUR	4.100.586,14				4.100.586,14	17,62
Summe der Bankguthaben							EUR	21.658.807,13	93,08
Sonstige Vermögensgegenstände									
Sonstige Ansprüche			EUR	5.974,47				5.974,47	0,02
Initial Margin			EUR	1.500.000,00				1.500.000,00	6,44
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	1.505.974,47	6,46
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-22.011,45			EUR	-22.011,45	-0,09
Fondsvermögen							EUR	23.268.872,20	100*
Anteilwert									
Quant.El-Erian EB							EUR	93,51	
Quant.El-Erian I							EUR	92,55	
Umlaufende Anteile									
Quant.El-Erian EB							STK	248.730	
Quant.El-Erian I							STK	110	

Fußnoten:

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

1) noch nicht abgeführte Verwahrstellenvergütung, Transaktionsgebühren, Verwaltungsvergütung, Veröffentlichungskosten, Prüfungskosten

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 48,38%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 119.470,51 EUR.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)			per 30.06.2014
US-Dollar	USD	1,364150	= 1 Euro (EUR)
Marktschlüssel			
c) OTC	Over-the-Counter		

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Fehlanzeige					

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 2.691.477,32

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

UBS Deutschland AG
State Street Bank GmbH

Bestand der Wertpapiere am
Fondsvermögen (in %) 0,52
Bestand der Derivate am
Fondsvermögen (in %) 0,03

Sonstige Angaben

Anteilwert

Quant.El-Erian EB EUR 93,51
Quant.El-Erian I EUR 92,55

Umlaufende Anteile

Quant.El-Erian EB STK 248.730
Quant.El-Erian I STK 110

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögens- gegenstände

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).

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
E-Mail: service@hansainvest.de

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 10.500.000,-
Haftendes Eigenkapital:
€ 10.208.910,33
(Stand: 31.12.2013)

Gesellschafter:

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

Verwahrstelle:

State Street Bank GmbH, München
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 109.300.000,-
Haftendes Eigenkapital:
€ 1.381.400.000,-
(Stand: 31.12.2013)

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)

Michael Petmecky
(stellvertretender Vorsitzender),
Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA
Gruppe, Hamburg (zugleich Aufsichts-
rats-Mitglied der SIGNAL IDUNA Asset
Management GmbH)

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, Leiter Parlaments-
und Europaangelegenheiten, 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

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

Dirk Zabel

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
www.hansainvest.de