

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2017

Quant.Sigma Pro

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Quant.Sigma Pro

in der Zeit vom 1. Januar 2017 bis 30. Juni 2017.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von - 6,41 % in der Class EB.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Investmentvermögens im Detail per Ende Juni darstellte. 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 August 2017

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensaufstellung per 30. Juni 2017	4
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	14
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	15

Vermögensaufstellung per 30. Juni 2017

Fondsvermögen: EUR 9.349.891,77 (9.990.658,05)

Umlaufende Anteile: EB-Klasse 107.330 (107.330)

Vermögensübersicht zum 30.06.2017			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	
I. Vermögensgegenstände			
1. Anleihen	40.193,80	0,43	(0,40)
2. Derivate	2.331.626,41	24,93	(5,50)
3. Bankguthaben	7.000.718,03	74,88	(94,47)
4. Sonstige Vermögensgegenstände	8.083,32	0,09	(0,04)
II. Verbindlichkeiten	-30.729,79	-0,33	(-0,41)
III. Fondsvermögen	9.349.891,77	100,00	

(Angaben in Klammern per 31.12.2016)

Vermögensaufstellung zum 30.06.2017

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens	
					im Berichtszeitraum					
Börsengehandelte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
0,000000000% Niederlande EO-Anl. 15/18	NL0011005137		EUR	40	0	0	% 100,484500	40.193,80	0,43	
Summe der börsengehandelten Wertpapiere								EUR	40.193,80	0,43
Summe Wertpapiervermögen								EUR	40.193,80	0,43
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
Devisen-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten										
Devisenterminkontrakte (Verkauf)										
Offene Positionen										
USD/SEK 1,16 Mio.		OTC						66.411,03	0,71	
EUR/GBP 0,30 Mio.		OTC						-3.966,38	-0,04	
EUR/GBP 0,20 Mio.		OTC						-4.541,32	-0,05	
USD/JPY 1,30 Mio.		OTC						-2.900,05	-0,03	
EUR/GBP 0,30 Mio.		OTC						-3.285,03	-0,04	
USD/JPY 1,49 Mio.		OTC						-21.787,35	-0,23	
USD/CHF 0,32 Mio.		OTC						11.026,59	0,12	
USD/CHF 2,00 Mio.		OTC						74.736,00	0,80	
EUR/USD 0,32 Mio.		OTC						-18.912,22	-0,20	
USD/CAD 2,60 Mio.		OTC						40.324,27	0,43	
USD/JPY 0,44 Mio.		OTC						-3.182,93	-0,03	
AUD/USD 1,92 Mio.		OTC						-3.654,72	-0,04	
USD/JPY 1,80 Mio.		OTC						10.977,76	0,12	
USD/JPY 2,37 Mio.		OTC						1.548,75	0,02	
AUD/USD 1,50 Mio.		OTC						-369,15	0,00	
EUR/USD 2,42 Mio.		OTC						-166.193,40	-1,78	
USD/JPY 0,70 Mio.		OTC						-4.004,26	-0,04	
USD/JPY 1,25 Mio.		OTC						2.493,40	0,03	
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						-2.626,92	-0,03	
EUR/USD 2,50 Mio.		OTC						-163.607,02	-1,75	
AUD/JPY 0,30 Mio.		OTC						74,17	0,00	
EUR/USD 0,40 Mio.		OTC						-2.683,66	-0,03	
EUR/USD 0,40 Mio.		OTC						-1.479,58	-0,02	
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						485,01	0,01	
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-770,29	-0,01	
USD/JPY 0,40 Mio.		OTC						-1.831,19	-0,02	
AUD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-5.041,42	-0,05	
EUR/USD 0,30 Mio.		OTC						-1.889,33	-0,02	
GBP/USD 0,08 Mio.		OTC						-351,71	0,00	
AUD/USD 0,40 Mio.		OTC						-1.991,50	-0,02	
EUR/USD 0,30 Mio.		OTC						-3.637,67	-0,04	
EUR/USD 0,50 Mio.		OTC						-4.397,88	-0,05	
AUD/USD 0,50 Mio.		OTC						-5.717,08	-0,06	
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						449,36	0,00	
AUD/USD 0,60 Mio.		OTC						-1.450,02	-0,02	
AUD/JPY 0,30 Mio.		OTC						-1.774,86	-0,02	

Vermögensaufstellung zum 30.06.2017

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
AUD/USD 0,50 Mio.		OTC						301,56	0,00
AUD/USD 0,50 Mio.		OTC						-8,30	0,00
AUD/USD 0,40 Mio.		OTC						-1.499,79	-0,02
EUR/USD 0,50 Mio.		OTC						-7.896,83	-0,08
AUD/USD 0,60 Mio.		OTC						-3.602,24	-0,04
EUR/USD 0,60 Mio.		OTC						-8.457,02	-0,09
EUR/USD 0,30 Mio.		OTC						-3.213,06	-0,03
EUR/USD 2,10 Mio.		OTC						-39.464,94	-0,42
AUD/USD 0,30 Mio.		OTC						-1.971,54	-0,02
AUD/USD 0,30 Mio.		OTC						-1.688,47	-0,02
AUD/USD 1,60 Mio.		OTC						-10.346,89	-0,11
AUD/USD 0,30 Mio.		OTC						-2.471,78	-0,03
AUD/USD 0,30 Mio.		OTC						-2.108,09	-0,02
USD/JPY 1,89 Mio.		OTC						-27.425,40	-0,29
USD/JPY 0,22 Mio.		OTC						-1.729,95	-0,02
EUR/USD 0,50 Mio.		OTC						-6.229,53	-0,07
AUD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-3.935,80	-0,04
GBP/USD 1,80 Mio.		OTC						-5.716,20	-0,06
AUD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-2.530,04	-0,03
AUD/USD 0,30 Mio.		OTC						-1.368,10	-0,01
AUD/USD 0,30 Mio.		OTC						-1.232,61	-0,01
EUR/USD 1,50 Mio.		OTC						-70.189,15	-0,75
EUR/USD 0,50 Mio.		OTC						-462,98	0,00
EUR/USD 0,60 Mio.		OTC						504,77	0,01
EUR/USD 0,50 Mio.		OTC						-1.839,55	-0,02
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-344,56	0,00
AUD/USD 0,42 Mio.		OTC						-5.981,15	-0,06
USD/JPY 0,30 Mio.		OTC						-4.609,82	-0,05
AUD/USD 2,05 Mio.		OTC						-24.222,45	-0,26
AUD/JPY 4,00 Mio.		OTC						-119.401,45	-1,28
AUD/USD 0,50 Mio.		OTC						-494,97	-0,01
EUR/GBP 0,25 Mio.		OTC						-287,12	0,00
EUR/SEK 0,60 Mio.		OTC						5.208,17	0,06
EUR/GBP 0,25 Mio.		OTC						1.937,50	0,02
USD/JPY 1,65 Mio.		OTC						-32.640,13	-0,35
AUD/USD 0,70 Mio.		OTC						-6.107,12	-0,07
USD/CHF 0,19 Mio.		OTC						5.088,29	0,05
EUR/USD 1,70 Mio.		OTC						-67.511,03	-0,72
Geschlossene Positionen									
AUD/USD 2,42 Mio.		OTC						19.078,38	0,20
USD/SEK 1,34 Mio.		OTC						33.177,43	0,35
USD/CAD 0,25 Mio.		OTC						4.902,57	0,05
USD/CAD 0,30 Mio.		OTC						2.452,88	0,03
AUD/USD 0,40 Mio.		OTC						-1.640,48	-0,02
EUR/GBP 0,10 Mio.		OTC						685,18	0,01

Vermögensaufstellung zum 30.06.2017

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
USD/CHF 2,00 Mio.		OTC						24.886,48	0,27
USD/CAD 0,70 Mio.		OTC						128,09	0,00
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						7.945,38	0,08
USD/CAD 1,45 Mio.		OTC						41.220,09	0,44
EUR/USD 0,40 Mio.		OTC						-217,41	0,00
EUR/USD 0,50 Mio.		OTC						1.058,36	0,01
USD/JPY 0,55 Mio.		OTC						7.087,67	0,08
USD/JPY 0,20 Mio.		OTC						-505,84	-0,01
AUD/USD 3,50 Mio.		OTC						36.830,62	0,39
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						1.895,98	0,02
USD/JPY 0,20 Mio.		OTC						6.879,89	0,07
USD/JPY 0,05 Mio.		OTC						764,34	0,01
USD/JPY 3,62 Mio.		OTC						23.627,00	0,25
USD/JPY 0,20 Mio.		OTC						6.280,55	0,07
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						4.268,28	0,05
USD/JPY 1,00 Mio.		OTC						-114.827,69	-1,23
EUR/USD 0,30 Mio.		OTC						-2.432,65	-0,03
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						4.613,60	0,05
EUR/JPY 0,53 Mio.		OTC						-6.250,71	-0,07
EUR/JPY 1,50 Mio.		OTC						-15.582,45	-0,17
USD/CHF 0,30 Mio.		OTC						8.532,00	0,09
AUD/USD 0,08 Mio.		OTC						-132,95	0,00
AUD/USD 0,50 Mio.		OTC						2.517,72	0,03
GBP/USD 0,03 Mio.		OTC						-8,53	0,00
AUD/USD 0,50 Mio.		OTC						1.635,74	0,02
USD/JPY 2,70 Mio.		OTC						-51.851,77	-0,55
USD/CHF 1,22 Mio.		OTC						-9.286,34	-0,10
AUD/USD 1,70 Mio.		OTC						36.052,71	0,39
USD/CAD 0,30 Mio.		OTC						37,51	0,00
Devisenterminkontrakte (Kauf)									
Offene Positionen									
EUR/USD 0,30 Mio.		OTC						12.418,70	0,13
AUD/USD 0,10 Mio.		OTC						2.443,98	0,03
AUD/USD 0,20 Mio.		OTC						5.076,07	0,05
USD/CHF 0,25 Mio.		OTC						-2.779,05	-0,03
EUR/USD 0,23 Mio.		OTC						3.101,98	0,03
AUD/USD 1,10 Mio.		OTC						27.714,60	0,30
USD/CHF 0,35 Mio.		OTC						-4.918,24	-0,05
EUR/USD 0,30 Mio.		OTC						18.442,68	0,20
EUR/USD 0,30 Mio.		OTC						19.885,63	0,21
EUR/USD 0,20 Mio.		OTC						12.023,06	0,13
USD/CAD 0,25 Mio.		OTC						-476,10	-0,01
USD/CAD 0,15 Mio.		OTC						-367,56	0,00
EUR/JPY 1,01 Mio.		OTC						29.176,50	0,31
GBP/USD 0,30 Mio.		OTC						10.079,14	0,11

Vermögensaufstellung zum 30.06.2017

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
AUD/USD 1,36 Mio.		OTC						13.810,70	0,15
GBP/USD 0,10 Mio.		OTC						2.771,58	0,03
GBP/USD 0,30 Mio.		OTC						9.028,09	0,10
NZD/USD 0,40 Mio.		OTC						3.174,56	0,03
EUR/JPY 0,60 Mio.		OTC						9.340,06	0,10
AUD/USD 1,00 Mio.		OTC						25.328,64	0,27
USD/CHF 0,20 Mio.		OTC						-1.370,27	-0,02
EUR/USD 0,30 Mio.		OTC						12.832,10	0,14
USD/CHF 0,30 Mio.		OTC						-662,33	-0,01
NZD/USD 0,50 Mio.		OTC						3.508,56	0,04
USD/CHF 0,30 Mio.		OTC						-2.479,04	-0,03
USD/JPY 0,70 Mio.		OTC						72.078,37	0,77
Geschlossene Positionen									
EUR/USD 1,47 Mio.		OTC						-12.506,81	-0,13
USD/JPY 0,30 Mio.		OTC						1.469,68	0,01
USD/JPY 0,20 Mio.		OTC						1.082,97	0,01
EUR/JPY 1,65 Mio.		OTC						17.130,01	0,18
USD/JPY 0,20 Mio.		OTC						2.059,48	0,02
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						5.533,70	0,06
USD/JPY 0,18 Mio.		OTC						-85,58	0,00
GBP/USD 1,20 Mio.		OTC						-14.728,10	-0,16
GBP/USD 0,20 Mio.		OTC						5.832,98	0,06
GBP/USD 2,97 Mio.		OTC						24.083,28	0,26
USD/JPY 0,30 Mio.		OTC						3.587,55	0,04
USD/JPY 0,20 Mio.		OTC						2.359,36	0,03
NZD/USD 1,70 Mio.		OTC						7.640,17	0,08
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						7.804,36	0,08
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						8.516,58	0,09
GBP/USD 0,30 Mio.		OTC						9.195,62	0,10
EUR/USD 0,60 Mio.		OTC						-6.409,71	-0,07
EUR/USD 1,07 Mio.		OTC						-53.299,59	-0,57
EUR/USD 0,67 Mio.		OTC						-33.710,26	-0,36
USD/JPY 4,25 Mio.		OTC						309.895,57	3,31
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						26.584,63	0,28
EUR/CHF 0,40 Mio.		OTC						-112,59	0,00
USD/JPY 0,80 Mio.		OTC						5.282,81	0,06
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Devisen									
Call Devisenopt.AUD/USD Call 18.06.2018 0,7925 0,792500000 18.06.2018	DE000FXD3841		STK	5.000				67.364,00	0,72
Call Devisenopt.JPY/AUD Call 27.09.2017 80 80,000000000 27.09.2017	DE000FXD3783		STK	-2.000				-5.409,81	-0,06
Put Devisenopt.EUR/USD Put 20.07.2017 1,092 1,092000000 20.07.2017	DE000FXD3866		STK	-5.000				-118,17	0,00
Call Devisenopt.USD/JPY Call 13.09.2017 110,50 110,500000000 13.09.2017	DE000FXD3825		STK	4.000				86.148,66	0,92
Call Devisenopt.EUR/USD Call 19.10.2017 1,18 1,180000000 19.10.2017	DE000FXD3544		STK	10.000				64.291,65	0,69

Vermögensaufstellung zum 30.06.2017

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Put Devisenopt.USD/JPY Put 24.07.2017 105 105,00000000 24.07.2017	DE000FXD3577		STK	5.000				141,01	0,00
Call Devisenopt.AUD/USD Call 13.12.2017 0,764 0,764000000 13.12.2017	DE000FXD3817		STK	5.000				81.390,87	0,87
Put Devisenopt.EUR/USD Put 20.07.2017 1,105 1,105000000 20.07.2017	DE000FXD3858		STK	5.000				792,16	0,01
Call Devisenopt.AUD/USD Call 11.07.2017 0,75 0,750000000 11.07.2017	DE000FXD3510		STK	5.000				78.839,34	0,84
Call Devisenopt.USD/CAD Call 16.10.2017 1,318 1,318000000 16.10.2017	DE000FXD3528		STK	5.000				38.951,98	0,42
Call Devisenopt.USD/CHF Call 18.10.2017 1,005 1,005000000 18.10.2017	DE000FXD3536		STK	5.000				6.832,21	0,07
Put Devisenopt.EUR/JPY Put 21.09.2017 100 100,00000000 21.09.2017	DE000FXD3551		STK	4.000				0,34	0,00
Call Devisenopt.EUR/CAD Call 13.12.2017 1,66 1,660000000 13.12.2017	DE000FXD3718		STK	4.000				5.658,64	0,06
Put Devisenopt.AUD/USD Put 06.10.2017 0,702 0,702000000 06.10.2017	DE000FXD3684		STK	7.000				4.007,18	0,04
Call Devisenopt.USD/SEK Call 10.07.2017 9,1 9,100000000 10.07.2017	DE000FXD3486		STK	3.000				0,62	0,00
Put Devisenopt.USD/SEK Put 10.07.2017 8,75 8,750000000 10.07.2017	DE000FXD3494		STK	-1.500				-42.091,77	-0,45
Call Devisenopt.USD/CHF Call 30.11.2017 0,98 0,980000000 30.11.2017	DE000FXD0342		STK	1				5.678,88	0,06
Call Devisenopt.AUD/JPY Call 27.09.2017 83 83,000000000 27.09.2017	DE000FXD3775		STK	7.000				205.459,38	2,20
Put Devisenopt.GBP/USD Put 04.07.2017 1,27 1,270000000 04.07.2017	DE000FXD3791		STK	5.000				157,56	0,00
Put Devisenopt.EUR/GBP Put 16.08.2017 0,854 0,854000000 16.08.2017	DE000FXD3742		STK	2.500				4.469,72	0,05
Put Devisenopt.AUD/USD Put 12.10.2017 0,69 0,690000000 12.10.2017	DE000FXD3726		STK	7.000				2.365,09	0,03
Put Devisenopt.EUR/USD Put 21.7.2017 1,09 1,090000000 21.07.2017	DE000FXD3759		STK	10.000				210,07	0,00
Call Devisenopt.EUR/USD Call 21.7.2017 1,145 1,145000000 21.07.2017	DE000FXD3767		STK	-3.000				-18.696,66	-0,20
Put Devisenopt.NZD/USD Put 17.07.2017 0,71 0,710000000 17.07.2017	DE000FXD3833		STK	9.000				4.813,34	0,05
Put Devisenopt.AUD/USD Put 25.06.2018 0,7078 0,707800000 25.06.2018	DE000FXD3874		STK	5.000				45.918,86	0,49
Call Devisenopt.USD/CHF Call 10.07.2017 1,009 1,009000000 10.07.2017	DE000FXD3692		STK	5.000				4,57	0,00
Call Devisenopt.EUR/GBP Call 16.08.2017 0,854 0,854000000 16.08.2017	DE000FXD3734		STK	2.500				78.467,44	0,84
Call Devisenopt.USD/JPY Call 08.11.2017 114,4 114,400000000 08.11.2017	DE000FXD3676		STK	4.000				40.126,37	0,43
Call Devisenopt.GBP/USD Call 07.11.2017 1,328 1,328000000 07.11.2017	DE000FXD3650		STK	5.000				65.394,55	0,70
Call Devisenopt.EUR/USD Call 08.12.2017 1,116 1,116000000 08.12.2017	DE000FXD3700		STK	4.000				156.918,90	1,68
Call Devisenopt.EUR/JPY Call 08.11.2017 125,75 125,750000000 08.11.2017	DE000FXD3668		STK	4.000				146.322,43	1,56
Call Devisenopt.EUR/USD Call 25.04.2018 1,156 1,156000000 25.04.2018	DE000FXD3593		STK	5.000				149.682,70	1,60
Put Devisenopt.EUR/CHF Put 02.08.2017 1,057 1,057000000 02.08.2017	DE000FXD3635		STK	3.000				378,65	0,00
Call Devisenopt.AUD/USD Call 14.08.2017 0,78 0,780000000 14.08.2017	DE000FXD2975		STK	5.000				15.116,64	0,16
Call Devisenopt.EUR/USD Call 23.02.2018 1,08 1,080000000 23.02.2018	DE000FXD3080		STK	5.000				360.685,37	3,86
Call Devisenopt.USD/CAD Call 08.09.2017 1,34 1,340000000 08.09.2017	DE000FXD3148		STK	3.000				7.210,11	0,08

Vermögensaufstellung zum 30.06.2017

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Call Devisenopt.USD/JPY Call 19.12.2017 112 112,000000000 19.12.2017	DE000FXD3213		STK	5.000				99.230,40	1,06
Call Devisenopt.USD/JPY Call 14.09.2017 116 116,000000000 14.09.2017	DE000FXD2843		STK	5.000				18.331,17	0,20
Call Devisenopt.USD/JPY Call 14.09.2017 116 116,000000000 14.09.2017	DE000FXD2843		STK	5.000				18.331,17	0,20
Call Devisenopt.USD/JPY Call 13.07.2017 107 107,000000000 13.07.2017	DE000FXD1555		STK	5.000				215.192,26	2,30
Call Devisenopt.EUR/USD Call 28.07.2017 1,132 1,132000000 28.07.2017	DE000FXD1613		STK	-3.000				-42.101,62	-0,45
Put Devisenopt.EUR/USD Put 16.01.2018 0,987 0,987000000 16.01.2018	DE000FXD2686		STK	-3.000				-559,32	-0,01
Call Devisenopt.AUD/USD Call 18.07.2017 0,775 0,775000000 18.07.2017	DE000FXD2728		STK	8.000				17.044,07	0,18
Put Devisenopt.USD/JPY Put 14.09.2017 94,7 94,700000000 14.09.2017	DE000FXD2371		STK	10.000				59,64	0,00
Call Devisenopt.USD/JPY Call 14.09.2017 130,1 130,100000000 14.09.2017	DE000FXD2389		STK	10.000				10,73	0,00
Put Devisenopt.USD/JPY Put 13.07.2017 107 107,000000000 13.07.2017	DE000FXD2496		STK	-5.000				-122,16	0,00
Call Devisenopt.EUR/USD Call 16.01.2018 1,1275 1,127500000 16.01.2018	DE000FXD2678		STK	6.000				214.229,07	2,29
Call Devisenopt.AUD/USD Call 18.09.2017 0,785 0,785000000 18.09.2017	DE000FXD3221		STK	5.000				19.965,86	0,22
Call Devisenopt.USD/JPY Call 05.10.2017 111,95 111,950000000 05.10.2017	DE000FXD3460		STK	5.000				80.681,08	0,86
Put Devisenopt.EUR/USD Put 28.07.2017 1,132 1,132000000 28.07.2017	DE000FXD1621		STK	3.000				11.002,67	0,12
Call Devisenopt.EUR/USD Call 28.07.2017 1,20 1,200000000 28.07.2017	DE000FXD2207		STK	-5.000				-796,53	-0,01
Call Devisenopt.EUR/JPY Call 08.11.2017 127 127,000000000 08.11.2017	DE000FXD3908		STK	-5.000				-150.384,28	-1,61
Put Devisenopt.EUR/JPY Put 08.11.2017 118,5 118,500000000 08.11.2017	DE000FXD3890		STK	15.000				52.317,52	0,56
Call Devisenopt.USD/CAD Call 28.09.2017 1,345 1,345000000 28.09.2017	DE000FXD3916		STK	4.000				11.791,74	0,13
Put Devisenopt.USD/CAD Put 28.09.2017 1,275 1,275000000 28.09.2017	DE000FXD3924		STK	4.000				24.338,33	0,26
Call Devisenopt.EUR/USD Call 03.07.2017 1,1215 1,121500000 03.07.2017	DE000FXD3882		STK	5.000				92.839,95	0,99
Summe der Devisen-Derivate							EUR	2.331.626,41	24,93

Vermögensaufstellung zum 30.06.2017

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	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	176.450,11				176.450,11	1,89
Bank: BHF-Bank AG			EUR	1.298.700,00				1.298.700,00	13,89
Bank: Donner & Reuschel AG			EUR	643.248,44				643.248,44	6,88
Bank: National-Bank AG			EUR	1.493.173,71				1.493.173,71	15,97
Bank: Norddeutsche Landesbank -GZ-			EUR	1.793.097,19				1.793.097,19	19,18
Bank: UBS AG			EUR	1.100.025,00				1.100.025,00	11,76
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	498.182,00				498.182,00	5,33
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen:									
			GBP	0,43				0,49	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:									
			CAD	3,16				2,13	0,00
Summe der Bankguthaben							EUR	7.002.879,07	74,90
Sonstige Vermögensgegenstände									
Sonstige Ansprüche			EUR	8.083,32				8.083,32	0,09
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	8.083,32	0,09
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme									
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen			USD	-2.468,88				-2.161,04	-0,02
Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-2.161,04	-0,02
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-30.729,79			EUR	-30.729,79	-0,33
Fondsvermögen							EUR	9.349.891,77	100*
Anteilwert							EUR	87,11	
Umlaufende Anteile							STK	107.330	

Fußnoten:

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

1) noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Give-Up Gebühren, Verluste aus Kassageschäfte , Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Zinsen lfd. Konto

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Investmentvermögens 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 Investmentvermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)			per 30.06.2017
Australischer Dollar	AUD	1,487850	= 1 Euro (EUR)
Australischer Dollar	AUD	1,302769	= 1 US-Dollar (USD)
Australischer Dollar	AUD	0,011624	= 1 Japanischer Yen (JPY)
Kanadischer Dollar	CAD	1,483750	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	1,093350	= 1 Euro (EUR)
Euro	EUR	0,870718	= 1 US-Dollar (USD)
Euro	EUR	1,136249	= 1 Britisches Pfund (GBP)
Euro	EUR	0,007768	= 1 Japanischer Yen (JPY)
Euro	EUR	0,103178	= 1 Schwedische Krone (SEK)
Britisches Pfund	GBP	0,879250	= 1 Euro (EUR)
Britisches Pfund	GBP	0,769451	= 1 US-Dollar (USD)
Japanischer Yen	JPY	128,605000	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland-Dollar	NZD	1,565150	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland-Dollar	NZD	1,370423	= 1 US-Dollar (USD)
Schwedische Krone	SEK	9,692250	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,142450	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	0,117938	= 1 Schwedische Krone (SEK)
US-Dollar	USD	1,045570	= 1 Schweizer Franken (CHF)
US-Dollar	USD	0,008936	= 1 Japanischer Yen (JPY)
US-Dollar	USD	0,771255	= 1 Kanadischer Dollar (CAD)

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
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Devisenterminkontrakte (Verkauf)					
Verkauf von Devisen auf Termin:					
EUR		USD			35.289,00
USD		JPY			59.130,01
NOK		SEK			942,35
AUD		JPY			5.564,43
EUR		GBP			8.350,00
GBP		USD			33.250,94
EUR		NZD			3.846,00
USD		CAD			5.933,69
EUR		SEK			1.800,00
JPY		EUR			334,95
USD		CHF			756,16
EUR		AUD			6.750,00
NZD		USD			7.439,27
AUD		USD			23.379,63
AUD		CAD			2.470,78
EUR		JPY			12.732,00
Devisenterminkontrakte (Kauf)					
Kauf von Devisen auf Termin:					
EUR		CAD			400,00
EUR		USD			17.992,00
GBP		USD			819,57
USD		CAD			6.722,09
USD		JPY			36.655,09
EUR		NOK			6.950,00
EUR		SEK			3.950,00
NOK		SEK			553,92
USD		CHF			1.499,46
NZD		USD			7.519,83
AUD		USD			5.768,52
EUR		JPY			9.500,00

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 25.276.300,92

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Donner & Reuschel AG
Toronto-Dominion Bank
UBS AG
UBS Europe SE

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	0,43
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	24,93

Sonstige Angaben

Anteilwert - Quant.Sigma Pro EB	EUR	87,11
Umlaufende Anteile	STK	107.330

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

Angaben zur Mitarbeitervergütung für das Geschäftsjahr 2016

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer):	EUR 14.500.104,02
davon fix:	EUR 11.907.583,74
davon variabel:	EUR 2.592.520,28
Zahl der Mitarbeiter der KVG: 193	
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr 2016 der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker (nur Führungskräfte):	EUR 1.201.000,08

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:
€ 11.306.775,13
Haftendes Eigenkapital:
€ 14.184.724,34
(Stand: 31.12.2016)

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:
€ 109,3 Mio.
Haftendes Eigenkapital:
€ 2.200,9 Mio.
(Stand: 31.12.2016)

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