

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2016

Quant.Euro Long Variable

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Quant.Euro Long Variable

in der Zeit vom 1. Januar 2016 bis 30. Juni 2016.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von -5,02 % in der Class EB.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Sondervermögens 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 Juli 2016

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensaufstellung per 30. Juni 2016	4
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	9

Vermögensaufstellung per 30. Juni 2016

Fondsvermögen: EUR 38.207.012,35 (40.480.689,07)

Umlaufende Anteile: Stück 447.200 (447.200)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
Aktien			
Inland	10.492	27,46	(27,75)
Ausland	23.038	60,30	(58,21)
Derivate	-317	-0,83	(-1,13)
Barvermögen	4.533	11,86	(7,02)
sonstige Vermögensgegenstände	485	1,27	(8,22)
sonstige Verbindlichkeiten	-24	-0,06	(-0,07)
	38.207	100,00	

(Angaben in Klammern per 31.12.2015)

Vermögensaufstellung zum 30.06.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2016	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Air Liquide	FR0000120073		STK	6.178	528	0	EUR 93,030000	574.739,34	1,50
Airbus Group	NL0000235190		STK	10.574	1.260	0	EUR 51,930000	549.107,82	1,44
Allianz	DE0008404005		STK	8.318	886	0	EUR 127,000000	1.056.386,00	2,77
Anheuser-Busch InBev	BE0003793107		STK	13.901	1.446	0	EUR 114,400000	1.590.274,40	4,16
ASML Holding	NL0010273215		STK	6.773	704	0	EUR 86,360000	584.916,28	1,53
Assicurazioni Generali	IT0000062072		STK	24.476	2.504	0	EUR 10,390000	254.305,64	0,67
AXA	FR0000120628		STK	38.021	4.014	0	EUR 17,840000	678.294,64	1,78
Banco Bilbao	ES0113211835		STK	115.129	14.053	0	EUR 5,017000	577.602,19	1,51
BASF	DE000BASF111		STK	16.634	1.674	0	EUR 67,530000	1.123.294,02	2,94
Bayer	DE000BAY0017		STK	14.970	1.576	0	EUR 89,110000	1.333.976,70	3,49
Bayerische Motoren Werke	DE0005190003		STK	5.822	592	0	EUR 65,880000	383.553,36	1,00
Bco Santander Cen. Hisp.	ES0113900J37		STK	261.149	32.840	0	EUR 3,476000	907.753,92	2,38
BNP Paribas	FR0000131104		STK	20.199	2.096	0	EUR 39,510000	798.062,49	2,09
Carrefour	FR0000120172		STK	10.098	0	126	EUR 21,960000	221.752,08	0,58
Compagnie de Saint-Gobain	FR0000125007		STK	9.031	866	0	EUR 34,380000	310.485,78	0,81
Daimler	DE0007100000		STK	18.060	1.844	0	EUR 53,730000	970.363,80	2,54
Danone	FR0000120644		STK	11.050	1.320	0	EUR 61,360000	678.028,00	1,77
Deutsche Bank	DE0005140008		STK	24.950	3.814	0	EUR 12,660000	315.867,00	0,83
Deutsche Post	DE0005552004		STK	17.346	1.756	0	EUR 24,865000	431.308,29	1,13
Deutsche Telekom	DE0005557508		STK	57.387	7.058	0	EUR 15,015000	861.665,81	2,26
E.ON SE	DE000ENAG999		STK	36.238	3.696	0	EUR 8,778000	318.097,16	0,83
Enel	IT0003128367		STK	126.772	21.824	0	EUR 3,900000	494.410,80	1,29
Engie S.A.	FR0010208488		STK	29.347	2.978	0	EUR 14,035000	411.885,15	1,08
ENI	IT0003132476		STK	45.980	2.136	0	EUR 14,300000	657.514,00	1,72
Essilor Intl -Cie Génle Opt.	FR0000121667		STK	3.922	364	0	EUR 118,950000	466.521,90	1,22
Fresenius	DE0005785604		STK	7.248	898	0	EUR 65,240000	472.859,52	1,24
Iberdrola	ES0144580Y14		STK	103.604	9.749	0	EUR 5,940000	615.407,76	1,61
Industria de Diseño Textil	ES0148396007		STK	19.010	1.954	0	EUR 29,810000	566.688,10	1,48
ING	NL0000303600		STK	69.981	7.304	0	EUR 9,012000	630.668,77	1,65
Intesa Sanpaolo	IT0000072618		STK	259.961	27.150	0	EUR 1,648000	428.415,73	1,12
Kon. Philips	NL0000009538		STK	17.229	2.056	0	EUR 21,975000	378.607,28	0,99
L'Oréal	FR0000120321		STK	4.396	422	0	EUR 170,000000	747.320,00	1,96
LVMH	FR0000121014		STK	4.871	474	0	EUR 135,750000	661.238,25	1,73
Münchener Rückversicherung	DE0008430026		STK	2.734	222	0	EUR 149,100000	407.639,40	1,07
Nokia	FI0009000681		STK	98.614	38.868	0	EUR 4,974000	490.506,04	1,28
Orange	FR0000133308		STK	36.832	5.440	0	EUR 14,620000	538.483,84	1,41
Safran	FR0000073272		STK	6.178	958	0	EUR 59,300000	366.355,40	0,96
Sanofi-Aventis	FR0000120578		STK	21.506	1.936	0	EUR 74,300000	1.597.895,80	4,18
SAP	DE0007164600		STK	17.466	1.980	0	EUR 67,720000	1.182.797,52	3,10
Schneider Electric	FR0000121972		STK	10.574	1.050	0	EUR 51,820000	547.944,68	1,43
Siemens	DE0007236101		STK	14.020	1.252	0	EUR 90,770000	1.272.595,40	3,33
Société Générale	FR0000130809		STK	14.614	1.536	0	EUR 27,910000	407.876,74	1,07
Telefónica	ES0178430E18		STK	77.941	7.418	0	EUR 8,329000	649.170,59	1,70

Vermögensaufstellung zum 30.06.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2016	Käufe/ Zugänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Total S.A.	FR0000120271		STK	44.079	5.310	0	EUR 42,950000	1.893.193,05	4,96
UniCredit	IT0004781412		STK	108.001	17.596	0	EUR 1,926000	208.009,93	0,54
Unilever	NL0000009355		STK	28.277	2.954	0	EUR 41,010000	1.159.639,77	3,04
VINCI	FR0000125486		STK	10.100	1.622	0	EUR 62,520000	631.452,00	1,65
Vivendi	FR0000127771		STK	21.148	322	0	EUR 16,505000	349.047,74	0,91
Volkswagen Vorzugsaktien	DE0007664039		STK	3.328	816	0	EUR 108,650000	361.587,20	0,95
Andere Wertpapiere									
Unibail-Rodamco	FR0000124711		STK	1.782	212	0	EUR 232,550000	414.404,10	1,08
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	33.529.971,18	87,76
Summe Wertpapiervermögen							EUR	33.529.971,18	87,76
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 16.09.2016	DE0009652388		STK	-153				-203.490,00	-0,53
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 16.09.2016	DE0009652388		STK	-140				-46.200,00	-0,12
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 16.09.2016	DE0009652388		STK	-210				-67.200,00	-0,18
Summe der Aktienindex-Derivate							EUR	-316.890,00	-0,83
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: State Street Bank International GmbH			EUR	4.532.946,53				4.532.946,53	11,86
Summe der Bankguthaben							EUR	4.532.946,53	11,86
Sonstige Vermögensgegenstände									
Dividendenansprüche			EUR	27.838,59				27.838,59	0,07
Quellensteueransprüche			EUR	20.635,55				20.635,55	0,06
Initial Margin			EUR	436.688,70				436.688,70	1,14
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	485.162,84	1,27
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-24.178,20			EUR	-24.178,20	-0,06
Fondsvermögen							EUR	38.207.012,35	100*)
Anteilwert - Quant.Euro Long Variable EB							EUR	85,44	
Umlaufende Anteile							STK	447.200	

Fußnoten:

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

1) noch nicht abgeführte Transaktionsgebühren, 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 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.

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

XEUR EUREX DEUTSCHLAND

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					
Andere Wertpapiere					
Iberdrola Anrechte	ES06445809B3	STK	93.855	93.855	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Andere Wertpapiere					
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Anrechte	ES06132119C3	STK	115.129	115.129	
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			4.845,52
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: DJES 50 Index (Price) (EUR)		EUR			262.593,52

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 14.179.570,00

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 %)	87,76
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,83

Sonstige Angaben

Anteilwert - Quant.Euro Long Variable EB	EUR	85,44
Umlaufende Anteile	STK	447.200

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).

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.

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,
Vorstandsvorsitzender 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 Aktiengesell-
schaft Wirtschaftsprüfungsgesellschaft,
Hamburg

Geschäftsführung:

Nicholas Brinckmann

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. 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 - 60 70

service@hansainvest.de
www.hansainvest.de