

# Halbjahresbericht zum 30. November 2018

Quant.LSE 100

# Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Quant.LSE 100

in der Zeit vom 1. Juni 2018 bis 30. November 2018.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von - 0,85 % in der Class-I  
und von - 1,33 % in der Class-R.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des  
Investmentvermögens im Detail per Ende November 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 Januar 2019

## So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensaufstellung per 30. November 2018 .....	4
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV .....	7
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien .....	9

# Vermögensaufstellung per 30. November 2018

Fondsvermögen: EUR 1.779.286,43 (2.047.533,88)

Umlaufende Anteile: I-Klasse 2.004 (2.288)

R-Klasse 21 (8)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	
<b>I. Vermögensgegenstände</b>			
<b>1. Anleihen</b>	1.670	93,84	(87,23)
<b>2. Derivate</b>	0	0,00	(-2,87)
<b>3. Bankguthaben</b>	104	5,86	(15,52)
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	18	1,00	(0,55)
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	-12	-0,70	(-0,43)
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>1.780</b>	<b>100,00</b>	

(Angaben in Klammern per 31.05.2018)

## Vermögensaufstellung zum 30.11.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.11.2018	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>									
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
2,000000000% Dt.Apotheker- u. Ärztebank MTN-HPF Nts.v.13(20)A.1283	XS0960428091		EUR	200	0	100	% 103,699500	207.399,00	11,66
0,000000000% International Bank Rec. Dev. EO-MTN 99/19	XS0094374872		EUR	94	0	0	% 164,880000	154.987,20	8,71
0,000000000% NATIXIS Pfandbriefbank AG FLR-MTN-HPF Ser.17 v.14(20)	DE000A1YC1M5		EUR	200	0	0	% 100,345000	200.690,00	11,28
0,000000000% Niederösterreich, Land EO-FLR Schuldv. 2014(19)	AT0000A19UR7		EUR	300	0	0	% 100,171959	300.515,88	16,89
4,250000000% WL BANK AG Westf.Ld.Bodenkred. MTN Hyp.Pfandbr.264 v.2009(19)	DE000A0L0839		EUR	300	0	0	% 100,904500	302.713,50	17,01
<b>Summe der börsengehandelten Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>1.166.305,58</b>	<b>65,55</b>
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>									
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
2,125000000% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15157 v.12(19)	DE000A1MLUW0		EUR	200	200	0	% 101,220000	202.440,00	11,38
1,750000000% Nykredit Realkredit A/S EO-Med.-Term Cov.Bds 2013(19)	LU0996352158		EUR	300	0	0	% 100,293000	300.879,00	16,91
<b>Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>503.319,00</b>	<b>28,29</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>1.669.624,58</b>	<b>93,84</b>
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
Verwahrstelle: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG			EUR	104.287,45				104.287,45	5,86
<b>Summe der Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>104.287,45</b>	<b>5,86</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Zinsansprüche			EUR	17.810,96				17.810,96	1,00
<b>Summe sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>17.810,96</b>	<b>1,00</b>
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-12.436,56			EUR	-12.436,56	-0,70
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>1.779.286,43</b>	<b>100*)</b>
<b>Anteilwert - Quant.LSE 100 I</b>							<b>EUR</b>	<b>886,97</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>2.004</b>	
<b>Anteilwert - Quant.LSE 100 R</b>							<b>EUR</b>	<b>85,50</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>21</b>	

### Fußnoten:

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

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

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Investmentvermögens über Broker ausgeführt wurden, die verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00EUR.

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Investmentvermögens 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
<b>An freien Märkten gehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
1,000000000% Kreissparkasse Köln Hyp.Pfdbr.Em.1072 v.13(18)	DE000A1TM3Q7	EUR	-	200	
<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: DJES 50 Index (Price) (EUR)		EUR			16.655,88
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: DJES 50 Index (Price) (EUR)		EUR			19.469,72

# 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

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	93,84
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

## Sonstige Angaben

Anteilwert - Quant.LSE 100 I	EUR	886,97
Umlaufende Anteile	STK	2.004
Anteilwert - Quant.LSE 100 R	EUR	85,50
Umlaufende Anteile	STK	21

Anteilklasse I: Währung: EUR; Verwaltungsvergütung 0,90% p.a.; Ausgabeaufschlag i.H.v. 0,00%; Ertragsverwendung Ausschüttung

Anteilklasse R: Währung: EUR; Verwaltungsvergütung 1,55% p.a.; Ausgabeaufschlag i.H.v. 5,00%; Ertragsverwendung Ausschüttung

## 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).

## An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

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

## Angaben zur Mitarbeitervergütung der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH (KVG) für das Geschäftsjahr 2017

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer):	EUR	9.668.504,18
davon fix:	EUR	7.731.706,47
davon variabel:	EUR	1.936.797,71

Zahl der Mitarbeiter der KVG: 128

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr 2017 der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker (nur Führungskräfte): EUR 878.912,52

## Beschreibung, wie die Vergütungen und ggf. sonstige Zuwendungen berechnet wurden

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die Ausgestaltung des Vergütungssystems hat die Gesellschaft in einer internen Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis geregelt. Ziel ist es, ein Vergütungssystem sicherzustellen, das Fehlanreize zur Eingehung übermäßiger Risiken verhindert. Das Vergütungssystem der HANSAINVEST wird unter Einbeziehung des Risikomanagements und der Compliance Beauftragten mindestens jährlich auf seine Angemessenheit und die Einhaltung der rechtlichen Vorgaben überprüft. Eine Erörterung des Vergütungssystems mit dem Aufsichtsrat findet ebenfalls jährlich statt.

Die Vergütung der Mitarbeiter richtet sich grundsätzlich nach dem Manteltarifvertrag für das Versicherungswesen. Je nach Tätigkeit und Verantwortung erfolgt die Vergütung gemäß der entsprechenden Tarifgruppe. Die Ausgestaltung und Vergütungshöhen der Tarifgruppen werden zwischen Arbeitgeber- und Arbeitnehmerverbänden bzw. der Konzernmutter und den Betriebsräten verhandelt, die HANSAINVEST hat hierauf keinen Einfluss. Nur mit wenigen Mitarbeitern inkl. der leitenden Angestellten sind finanzielle Anreizsysteme für variable Vergütungen und Tantiemen vereinbart. Der Anteil der variablen Vergütung darf dabei maximal 30% der Gesamtvergütung ausmachen. Ein Anreiz, ein unverhältnismäßig großes Risiko für die Gesellschaft einzugehen, resultiert aus der variablen Vergütung nicht.

Die Vergütung für die Geschäftsführer der HANSAINVEST erfolgt auf einzelvertraglicher Basis. Sie setzt sich zusammen aus einer monatlichen festen Vergütung und einer jährlichen Tantieme. Die Höhe der Tantieme wird im gesamten Aufsichtsrat erörtert und festgelegt und orientiert sich nicht am Erfolg der einzelnen Fonds.

Derzeit sind nur die Geschäftsführung als Risikoträger der Gesellschaft eingestuft. Die Gesellschaft überprüft die Vergütungssysteme jährlich. Die Vergütungspolitik der HANSAINVEST erfüllt die Anforderungen der § 37 KAGB, als auch die Leitlinien für solide Vergütungspolitiken unter Berücksichtigung der AIFMD (ESMA/2013/232).

### **Ergebnisse der jährlichen Überprüfung der Vergütungspolitik**

Im Rahmen der internen jährlichen Überprüfung der Einhaltung der Vergütungspolitik ergaben sich keine Anhaltspunkte dafür, dass die Ausgestaltung von fixen und / oder variablen Vergütungen sich nicht an den Regelungen der Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis orientieren.

### **Angaben zu wesentlichen Änderungen der festgelegten Vergütungspolitik gem. § 101 Abs. 4 Nr. 5 KAGB**

Keine Änderung im Berichtszeitraum.

# Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien

## Kapitalverwaltungsgesellschaft:

HANSAINVEST  
Hanseatische Investment-Gesellschaft  
mit beschränkter Haftung  
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.com  
E-Mail: service@hansainvest.de

Gezeichnetes Kapital:  
€ 10.500.000,00  
Eigenmittel:  
€ 14.153.952,34  
(Stand: 31.12.2017)

## Gesellschafter:

SIGNAL IDUNA  
Allgemeine Versicherung AG, Dortmund  
SIGNAL IDUNA  
Lebensversicherung a.G., Hamburg

## Verwahrstelle:

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG  
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:  
€ 16.000.000,00  
Haftendes Eigenkapital (anrechenbare  
Eigenmittel nach Art. 72 CRR):  
€ 160.251.597,01  
(Stand 31.12.2017)

## 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, Wedel

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

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

Prof. Dr. Stephan Schüller,  
Kaufmann

## Wirtschaftsprüfer:

PricewaterhouseCoopers GmbH  
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft,  
Hamburg

## Geschäftsführung:

Nicholas Brinckmann  
(zugleich Sprecher 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](mailto:service@hansainvest.de)  
[www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)