

Halbjahresbericht zum 30. November 2019

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 2019 bis 30. November 2019.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von - 47,98 % in der Class-R.
Die Class-I wurde zum 08.11.2019 liquidiert.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des
Sondervermögen im Detail per Ende November darstellte. 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, Ludger Wibbeke

Hamburg, im Januar 2020

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensübersicht per 30. November 2019	4
Vermögensaufstellung per 30. November 2019	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	7
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	8

Vermögensübersicht per 30. November 2019

Fondsvermögen: EUR 904,52 (1.737.185,28)

Umlaufende Anteile: R Klasse 21 (21)

I Klasse *) 0 (2.004)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens per 31.05.2019
I. Vermögensgegenstände			
1. Anleihen	0	0,00	(90,10)
2. Derivate	0	0,00	(-2,27)
3. Bankguthaben	10	1.084,13	(12,20)
4. Sonstige Vermögensgegenstände	0	0,00	(0,50)
II. Verbindlichkeiten			
	-9	-984,13	(-0,53)
III. Fondsvermögen			
	1	100,00	

*) Die ASK I wurde zum 08.11.2019 aufgelöst

Vermögensaufstellung per 30. November 2019

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.11.2019	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG			EUR	9.806,34				9.806,34	1.084,15
Summe der Bankguthaben							EUR	9.806,34	1.084,15
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme									
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen			USD	-0,16				-0,15	-0,02
Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-0,15	-0,02
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-8.901,67			EUR	-8.901,67	-984,13
Fondsvermögen							EUR	904,52	100 2)
Quant.LSE 100 R									
Anteilwert							EUR	43,07	
Umlaufende Anteile							STK	21	

Fußnoten:

1) noch nicht abgeführte Veröffentlichungskosten, Prüfungskosten, Verwaltungsvergütung

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

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die 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.

Devisenkurse (in Mengennotiz)		per 29.11.2019	
US-Dollar	USD	1,100600	= 1 Euro (EUR)

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					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,609000000% BNG Bank N.V. EO-FLR Med.-T. Notes 2011(21)	XS0575962286	EUR	-	155	
0,625000000% Caixabank S.A. EO-Cédulas Hipotec. 2015(20)	ES0440609305	EUR	-	300	
0,000000000% Danske Bank AS EO-FLR Med.-T.Pfdbriefe 13(19)	XS0970895313	EUR	-	200	
2,000000000% Dt.Apotheker- u. Ärztebank MTN-HPF Nts.v.13(20)A.1283	XS0960428091	EUR	-	200	
0,875000000% DVB Bank SE MTN-IHS v. 15/21	XS1215290922	EUR	200	200	
0,000000000% NATIXIS Pfandbriefbank AG FLR-MTN-HPF Ser.17 v.14(20)	DE000A1YC1M5	EUR	-	200	
0,000000000% Niederösterreich, Land EO-FLR Schuldv. 2014(19)	AT0000A19UR7	EUR	-	300	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
2,125000000% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN-HPF Reihe 15157 v.12(19)	DE000A1MLUW0	EUR	-	200	
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Wertpapier-Terminkontrakte					
Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten					
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: Bundesrep.Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe		EUR			2.564,63
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
Basiswerte: DAX Index, ESTX 50 Index (Price) (EUR)		EUR			3.015,61
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: DAX Index		EUR			1.455,54
Basiswert: S&P 500 Index		USD			1.935,87
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices:					
Gekaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: DAX Index		EUR			85,86
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: DAX Index		EUR			79,49
Verkaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: ESTX 50 Index (Price) (EUR)		EUR			79,49
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: ESTX 50 Index (Price) (EUR)		EUR			62,95
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte:					
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: E-Mini S&P 500 Index Futures		USD			31,35

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 Sondervermögen

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Fehlanzeige

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

Sonstige Angaben

Quant.LSE 100 R		
Anteilwert	EUR	43,07
Umlaufende Anteile	STK	21

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Der Anteilwert wird durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH ermittelt. Die Bewertung von Vermögenswerten, die an einer Börse zum Handel zugelassen bzw. in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind, erfolgt zu den handelbaren Schlusskursen des vorhergehenden Börsentages gem. § 27 KARBV. Investmentanteile 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 bezogenen Kurse werden täglich durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft auf Vollständigkeit und Plausibilität geprüft.

Bankguthaben und Festgelder werden mit dem Nominalbetrag und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet. Die Bewertung der sonstigen Vermögensgegenstände erfolgt zu ihrem Markt- bzw. Nominalbetrag.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

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.

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 des § 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

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:
€ 21.729.099,42
(Stand: 31.12.2018)

Gesellschafter:

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

Verwahrstelle:

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 18.445.196,00
Haftendes Eigenkapital (aufsichtsrecht-
liche Eigenmittel nach Art. 72 CRR):
€ 202.020.403,81
(Stand 31.12.2018)

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:

KPMG AG Wirtschaftsprüfungs-
gesellschaft, Hamburg

Geschäftsführung:

Dr. Jörg W. Stotz
(Sprecher, zugleich Aufsichtsrats-
vorsitzender der HANSAINVEST LUX
S.A., Mitglied der Geschäftsführung
der SIGNAL IDUNA Asset Management
GmbH sowie Mitglied der Geschäftsfüh-
rung HANSAINVEST Real Assets GmbH)

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

Ludger Wibbeke (ab 01.07.2019)
(zugleich stellvertretender Aufsichtsrats-
vorsitzender der HANSAINVEST LUX
S.A.)

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