

Jahresbericht zum 31. August 2018

3ik-Strategiefonds II

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

3ik-Strategiefonds II

in der Zeit vom 01. September 2017 bis 31. August 2018.

Hamburg, im November 2018

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

Nicholas Brinckmann

Marc Drießen

Dr. Jörg W. Stotz

So behalten Sie den **Überblick:**

Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr 2017/2018	4
Vermögensaufstellung per 31. August 2018	6
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	13
Wiedergabe des Vermerks des Abschlussprüfers	16
Besteuerung der Wiederanlage zum 31.12.2017	17
Bescheinigung nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 InvStG	19
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	21

Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr 2017/2018

Gliederung

- 1) Wirtschaftliches Umfeld
- 2) Anlageziel/Anlagepolitik
- 3) Veräußerungsgewinne
- 4) Risikoberichterstattung
- 5) Darstellung des mit dem Portfoliomanagement betrauten Unternehmens
- 6) Sonstige Hinweise

Wirtschaftliches Umfeld

Das globale Wirtschaftswachstum lag im Berichtszeitraum auf einem konstanten Niveau von rund 3,5 Prozent im Durchschnitt.

Die **Konjunktur in Amerika** entwickelte sich im Berichtszeitraum robust und beschleunigte sich im zweiten Quartal 2018 mit 4,2 Prozent Wachstum des Bruttoinlandsproduktes. Bis zum Ende des Fondsgeschäftsjahres am 31.08.2018 hielten die wirtschaftlichen Auftriebskräfte mit bemerkenswerter Stärke an.

Eines der wichtigsten Projekte der bisherigen Amtszeit von US-Präsident Donald Trump war die große Steuerreform, die am 1. Januar 2018 in Kraft trat. Die deutliche Senkung der Ertragssteuern bei Unternehmen (von 35 auf 21 Prozent) und gleichzeitige Steuererleichterungen für Privatpersonen sorgten für die oben genannte Beschleunigung des Wirtschaftswachstums ab dem zweiten Quartal 2018.

Vor diesem Hintergrund ist es nicht verwunderlich, dass nach wie vor die amerikanische Binnenkonjunktur, der boomende Arbeitsmarkt (Jobsicherheit) und dem damit verbundenen hohen Verbraucher-

vertrauen das Rückgrat der Ökonomie darstellen. Die weltweiten Handelsstreitigkeiten, die sich aktuell stark auf die Auseinandersetzung zwischen Amerika und China konzentrieren, beeinflussten die amerikanischen Konsumenten bisher kaum.

Die amerikanische Notenbank Fed setzte im Berichtszeitraum die Straffung ihrer Geldpolitik fort und erhöhte dreimal um jeweils 0,25 Prozentpunkte den Leitzins: im Dezember 2017, im März und Juni 2018. Weitere Zinserhöhungen werden für September und Dezember 2018 erwartet.

Der **amerikanische Aktienmarkt** (S&P 500) erreichte im Berichtszeitraum einen Wertzuwachs in Höhe von 17,39 % (in US Dollar). Die **Rendite** 10-jähriger US-Staatsanleihen stieg in der Berichtsperiode deutlich von 2,13 % auf 2,84 % an, mit einem zwischenzeitlichen Renditehoch, Mitte Mai 2018, in Höhe von 3,09 %. Der **US Dollar** verzeichnete zum Euro eine moderate Aufwertung von 1,1906 auf 1,1607.

In **Europa** konnte die hohe wirtschaftliche Wachstumsdynamik des Jahres 2017 (2,5 %) im bisherigen Jahresverlauf 2018 nicht gehalten werden. Die vorliegenden Daten für die ersten acht Monate des Jahres deuten auf ein annualisiertes Wachstum von 2 Prozent hin. Die im Vergleich zu Amerika stärker exportorientierte europäische Wirtschaft wird von der Unsicherheit über die Auswirkungen der Handelsstreitigkeiten mit Amerika und der konjunkturellen Abkühlung in den Schwellenländern etwas gebremst.

Die Europäische Zentralbank halbierte in der Berichtsperiode ihr Anleihekaufprogramm von 60 Milliarden Euro monatlich auf 30 Milliarden. Im Juni 2018 kündigte die EZB eine weitere Reduzierung auf 15 Milliarden ab Oktober und ein Auslaufen der Käufe am Jahresende 2018 an. Das Dilemma der Geldpolitik im Euroraum zeigte sich ab Mai 2018, als die neue italienische Regierung mit Diskussionen über ein deutlich höheres Budgetdefizit (zur Finanzierung teurer Wahlversprechen) einen starken Renditeanstieg bei italienischen Staatsanleihen auslöste. Die Rendite der **10-jährigen Bundesanleihe** bewegte sich im Berichtszeitraum in einer Spanne von 0,27 % bis 0,78 %.

Der **Euro Stoxx 50** lag im Berichtszeitraum mit 0,84 % im Minus.

Japan verzeichnete in der Berichtsperiode insgesamt stabile politische und konjunkturelle Verhältnisse. Die auch auf absehbare Zeit expansive Geldpolitik der japanischen Notenbank unterstützte diese Entwicklung. Der Yen handelte zum Euro in einer Bandbreite von 125,38 zu 137,24 und zum Dollar zwischen 104,74 und 114,12. Der **Nikkei Index stieg im Berichtszeitraum** um 16,38 %.

Emerging Markets:

Die Volkswirtschaften und die Aktienkurse der asiatischen Schwellenländer, unter der Führung Chinas, litten im Jahresverlauf 2018 zunehmend unter den eskalierenden Handelsstreitigkeiten zwischen Amerika und China. Auch wenn die materiellen Auswirkungen bisher noch relativ gering sind, drückt die psychologische Komponente verbunden mit der Angst

um eine weitere Eskalation der gegenseitigen Strafmaßnahmen auf die wirtschaftliche Stimmung.

Der **MSCI Emerging Markets** Index (in Euro) verbuchte im Berichtszeitraum einen Kursrückgang in Höhe von 0,80 %.

Anlageziel / Anlagepolitik

Anlageziel des 3ik-Strategiefonds II ist es, in einem rollierenden Zeitraum von jeweils drei Jahren stets ein positives Ergebnis zu erreichen. Gleichzeitig wird das Ziel verfolgt, den Wertrückgang des 3ik-Strategiefonds II nach einem Höchststand auf maximal 10 % zu begrenzen.

Für den 3ik-Strategiefonds II werden nur Anlagewerte ausgewählt, von denen der Fondsmanager erwartet, dass sie nur mäßigen Wertschwankungen unterliegen. Jede Position wird fortlaufend beobachtet und einer gesonderten Prüfung unterworfen, wenn der Wertrückgang nach dem zuletzt erreichten Höchststand eine Grenze von 5 % überschreitet. Der Fondsmanager wird nach dieser Sonderprüfung entscheiden, ob der jeweilige Wert kurzfristig aus dem Fonds entfernt wird oder die Position in Erwartung einer alsbaldigen Erholung im Investmentvermögen verbleibt. Eine zweite besonders intensive Sonderprüfung erfolgt, wenn eine Einzelposition nach der ersten Prüfung trotz Erwartung einer Werterholung einen weiteren Rückgang von 5 % überschreitet.

Im Berichtszeitraum wurde die Allokation breit diversifiziert in folgenden Zielfondskategorien vorgenommen: Anleihefonds, Wandelanleihefonds, Mischfonds, Absolute Return Fonds, Aktienfonds. Situativ wurde die genannte Portfolioausrichtung durch diverse taktische Investments via Futures (long und short), ETFs und einzelnen Aktien ergänzt.

Wesentliche Angaben über die Herkunft des Veräußerungsergebnisses

Das Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften für den Berichtszeitraum betrug:

Class I: +110.423,67 EUR

Class R: +952,12 EUR

Die Ergebnisse aus Veräußerungsgeschäften wurden im Wesentlichen aus Kursgewinnen/-verlusten bei Indexfutures, Zinsfutures, Devisentermingeschäften, Investmentfonds, Aktien und Rententiteln erzielt.

Risikoberichterstattung

Operationelle Risiken

Der Asset-Manager hat umfangreiche Vorkehrungen zur Minimierung von operationellen Risiken getroffen. Im Berichtszeitraum waren keine derartigen Risiken zu verzeichnen.

Gemäß der Anlagestrategie wurden überwiegend solche Anlagewerte ausgewählt, deren **Marktpreisrisiko** unter normalen Umständen der Zielstellung der Anlagepolitik entspricht und nur mäßige Wertschwankungen erwarten lassen.

Adressenausfallrisiko

Die breite Streuung des Fondsvermögens sowohl in Zielfonds als auch bei der Investition in Einzeltitel reduziert die Auswirkung einer möglichen Insolvenz eines Unternehmens in das investiert wurde sehr stark. Die Gewichtung der Einzelpositionen bei Aktien und Zertifikaten (nur hier existiert ein einzelnes Adressenausfallrisiko) lag zwischen 0,3 % und 5 %.

Zinsänderungsrisiken

Beim 3ik-Strategiefonds II, mit einem Anteil an Rentenfonds, wird eine aktive Durationssteuerung vorgenommen. Je nach Situation werden auch Derivate zur Begrenzung des Zinsänderungsrisikos eingesetzt.

Währungsrisiken

Der 3ik-Strategiefonds II hat nur ein unterdurchschnittliches Währungsexposur. Das Fondsmanagement wird situativ Absicherungen vornehmen.

Liquiditätsrisiken

Sowohl bei der Auswahl der Zielfonds als auch der Einzeltitel wird der jederzeitigen Liquidierbarkeit der Positionen unter normalen Marktumständen einen hohen Stellenwert beigemessen.

Darstellung des mit dem Portfoliomanagement betrauten Unternehmens

Die mit der Verwaltung des Investmentvermögens betraute Kapitalverwaltungsgesellschaft ist die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH, Hamburg.

Das Portfoliomanagement ist ausgelagert an Gies & Heimburger GmbH.

Sonstige Hinweise

Die 1994 gegründete Gies & Heimburger GmbH ist ein unabhängiger Vermögensverwalter der Finanzportfolioverwaltung gemäß §32 KWG leistet:

- für Privatpersonen und Unternehmen,
- für Pensionskassen und Stiftungen,
- für Versicherungen und Treuhandvermögen.

Die Geschäftsführer verfügen im Rahmen ihrer langjährigen Tätigkeit in leitenden Positionen bei deutschen Großbanken über jeweils mehr als 25 Jahre Erfahrung in der Vermögensanlage, der Portfolioverwaltung und dem Börsenhandel.

Vermögensaufstellung per 31. August 2018

Fondsvermögen: EUR 117.847.558,17 (16.646.645,21)

Umlaufende Anteile: Class I 140.718 (134.843)

Class R 1.464 (1.553)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien	107	0,60	(1,83)
2. Zertifikate	0	0,00	(3,12)
3. Sonstige Wertpapiere	17.625	98,76	(81,63)
4. Derivate	-26	-0,14	(0,17)
5. Bankguthaben	176	0,98	(13,45)
II. Verbindlichkeiten			
	-35	-0,20	(-0,20)
III. Fondsvermögen			
	17.847	100,00	

(Angaben in Klammern per 31.08.2017)

Vermögensaufstellung zum 31.08.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2018	Käufe/ Zugänge		Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum					
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Motif Bio PLC Registered Shares LS -,01	GB00BVVT4H71		STK	296.500	0	0	GBP	0,325000	107.493,45	0,60
Summe der börsengehandelten Wertpapiere								EUR	107.493,45	0,60
Investmentanteile										
KVG-eigene Investmentanteile 2)										
4Q-SPECIAL INCOME	DE000A1JRQC3		ANT	5.560	0	0	EUR	126,120000	701.227,20	3,93
4Q-VALUE FONDS	DE0009781633		ANT	10.640	1.600	0	EUR	66,180000	704.155,20	3,95
Apus Capital Revalue Fonds	DE000A1H44E3		ANT	2.280	3.500	1.220	EUR	140,910000	321.274,80	1,80
Attila Global Opportunity Fund Inhaber-Anteile	DE000A0YJMM9		ANT	968	0	0	EUR	1.273,550000	1.232.796,40	6,91
TBF GLOBAL EQUITY LS Inhaber-Anteile EUR I	DE000A2JF8R4		ANT	5.400	5.400	0	EUR	95,880000	517.752,00	2,90
4Q-GROWTH FONDS	DE000A0D9PG7		ANT	3.750	0	0	USD	152,010000	488.987,78	2,74
Gruppenfremde Investmentanteile 3)										
ACEVO Gl.Healthcare Abs.Ret.Ul Inhaber-Anteile	DE000A1111D5		ANT	4.500	0	1.600	EUR	118,710000	534.195,00	2,99
AGIF V-Allianz Japan Small.Cos Inhaber-Anteile A EUR o.N.	IE0002554024		ANT	5.100	0	0	EUR	71,300000	363.630,00	2,04
Alpora Innovation Select Inhaber-Anteilsklasse I	DE000A2AJHJ1		ANT	9.605	0	770	EUR	138,610000	1.331.349,05	7,47
Atlantis Intl Umb.-Japan Opp. Registered Shares EUR o.N.	IE00B5TB9J06		ANT	9.140	0	0	EUR	48,738000	445.465,32	2,50
Bellevue Fds (L)-BB Ada.DI He. Namens-Anteile I EUR o.N.	LU1811047916		ANT	1.200	1.200	0	EUR	185,060000	222.072,00	1,24
Bellevue Fds (Lux)-BB Afr.Opp. Namens-Anteile I EUR o.N.	LU0433847323		ANT	1.650	1.650	0	EUR	209,230000	345.229,50	1,93
Bellevue Fds(Lux)-BB Adm.H.In. Namens-Anteile I EUR o.N.	LU1477743204		ANT	2.520	2.520	0	EUR	187,210000	471.769,20	2,64
BILKU 1-OPAL Fonds Actions au Port. Cl.AL o.N.	LU1457636733		ANT	5.500	0	0	EUR	93,420000	513.810,00	2,88
Calibrate Total Return Inhaber-Anteile	DE000A0YAEH5		ANT	4.630	0	920	EUR	98,870000	457.768,10	2,56
db x-tr.Harv.CSI300 UCITS ETF Inhaber-Anteile 1D o.N.	LU0875160326		ANT	41.800	79.800	38.000	EUR	8,232000	344.097,60	1,93
ETF5 DAXgbl Gold Min.Go UCITS	DE000A0Q8NC8		ANT	16.500	30.000	13.500	EUR	15,730000	259.545,00	1,45
FCP OP MEDICAL BIOHEALTH-TRENDS I (EUR)	LU0294851513		ANT	1.170	400	0	EUR	599,110000	700.958,70	3,93
GREIFF 'spec.situations' Fd Op Inh.-Anteile	LU0228348941		ANT	10.630	0	0	EUR	81,650000	867.939,50	4,87
H2O Allegro Act. au Port. I (4 Déc.) o.N.	FR0011006188		ANT	5	5	0	EUR	142.815,610000	714.078,05	4,00
ICBCCS WisdomTree S&P China500 Actions Nominatives B USD o.N.	LU1440654330		ANT	16.500	16.500	0	EUR	10,484000	172.986,00	0,97
IP Fonds-IP White T	LU1144474043		ANT	49.750	0	14.450	EUR	12,560000	624.860,00	3,50
iSh.ST.Eu.600 Bas.Res.U.ETF DE	DE000A0F5UK5		ANT	7.600	7.600	0	EUR	45,245000	343.862,00	1,93
Jupiter Gl.Fd.-J.Europ.Abs.Ret. Namens-Ant. L EUR A Acc.o.N.	LU0459992037		ANT	25.700	25.700	0	EUR	14,640000	376.248,00	2,11
LOYS Global MH	DE000A0H08T8		ANT	2.050	2.050	0	EUR	260,280000	533.574,00	2,99
Lupus alpha Fds-Glo.Conver.Bds Namens-Anteile C Hdgd o.N.	LU1535992389		ANT	4.950	0	0	EUR	106,170000	525.541,50	2,94
nova Steady HealthCare Inhaber-Anteile I EUR (dist.)	DE000A1145H4		ANT	4.300	0	1.200	EUR	143,240000	615.932,00	3,45
Palad.A.M.I.AG TGV-Paladin One Inhaber-Anlageaktien	DE000A1W1PH8		ANT	3.690	3.690	0	EUR	151,270000	558.186,30	3,13
ProfitlichSchmidlin Fonds Ul Inhaber-Anteile Ant.klasse I	DE000A1W9A36		ANT	425	0	75	EUR	1.253,780000	532.856,50	2,99
QanTRADE Adaptive L/S Strat.Ul Inhaber-Anteilsklasse I	DE000A2DMV40		ANT	8.170	8.170	0	EUR	91,410000	746.819,70	4,18
Struct.Sols-Lithium Index Str. Namens-Anteile o.N.	LU0470205575		ANT	6.360	2.980	0	EUR	88,310000	561.651,60	3,15
TAMAC Qilin-China Champions. Actions Nom.D EUR (INE) o.N.	LU1242508387		ANT	3.900	1.200	0	EUR	126,890000	494.871,00	2,76
Summe der Investmentanteile								EUR	17.625.489,00	98,76
Summe Wertpapiervermögen								EUR	17.732.982,45	99,36

Vermögensaufstellung zum 31.08.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.08.2018	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Wertpapier-Optionsscheine									
Optionsscheine auf Aktien									
Motif Bio PLC WTS 23.11.21	GB00BZ7Q1F72		STK	42.000				4.909,38	0,03
Summe der Wertpapier-Optionsscheine							EUR	4.909,38	0,03
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
DAX Future 21.09.2018	DE0008469594		STK	-1				-937,50	-0,01
DAX Future 21.09.2018	DE0008469594		STK	-1				1.762,50	0,01
DAX Future 21.09.2018	DE0008469594		STK	-1				462,50	0,00
CBOE VIX Future 17.10.2018	US12498A1016		STK	6				1.415,40	0,01
E-Mini Nasdaq 100 Index Futures 21.09.2018	XC0009665289		STK	-4				-16.114,09	-0,10
E-Mini Nasdaq 100 Index Futures 21.09.2018	XC0009665289		STK	-2				-1.256,70	-0,01
E-Mini Nasdaq 100 Index Futures 21.09.2018	XC0009665289		STK	-1				283,08	0,00
Summe der Aktienindex-Derivate							EUR	-14.384,81	-0,08
Devisen-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Verkauf)									
Offene Positionen									
USD/EUR 1,02 Mio.		OTC						-27.956,84	-0,16
JPY/EUR 25,86 Mio.		OTC						1.899,75	0,01
JPY/EUR 25,86 Mio.		OTC						1.709,73	0,01
JPY/EUR 25,86 Mio.		OTC						6.532,52	0,04
Geschlossene Positionen									
JPY/EUR 103,00 Mio.		OTC						1.081,33	0,01
Summe der Devisen-Derivate							EUR	-16.733,51	-0,09
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	173.193,62				173.193,62	0,97
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	644,85				644,85	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:									
			USD	2.720,96				2.334,08	0,01
Summe der Bankguthaben							EUR	176.172,55	0,98
Sonstige Verbindlichkeiten 1)							EUR	-35.387,89	-0,20
Fondsvermögen							EUR	17.847.558,17	100*
Anteilwert - 3ik-Strategiefonds II Class I							EUR	125,71	
Umlaufende Anteile							STK	140.718	
Anteilwert - 3ik-Strategiefonds II Class R							EUR	107,64	
Umlaufende Anteile							STK	1.464	

Fußnoten:

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

1) noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, 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 verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 100,00 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 200.820.372,29 EUR.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)			per 31.08.2018
Britisches Pfund	GBP	0,896450	= 1 Euro (EUR)
Japanischer Yen	JPY	129,820000	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,165750	= 1 Euro (EUR)
Marktschlüssel			
b) Terminbörsen			
XNAS	NASDAQ - ALL MARKETS		
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND		
XNYS	NEW YORK STOCK EXCHANGE, INC.		
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 (Marktzugordnung zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
BB Biotech	CH0038389992	STK	-	4.000	
Südzucker	DE0007297004	STK	14.200	14.200	
Zertifikate					
BNP PARIBAS ARBITR.ISSUANCE BV Gold Spot Price Zt.02(05/Und.)	DE0008593419	STK	-	4.725	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
Exane Fund 1 SICAV - Ceres Fd Actions Nominatives A o.N.	LU0284634564	ANT	-	15	
Fr.Temp.Inv.Fds -T.Gl.Bd Fd Namens-Ant. A (cap.) USD o.N.	LU0252652382	ANT	-	18.350	
iShsIII-MSCI Australia U.ETF Registered Shs USD (Acc) o.N.	IE00B5377D42	ANT	12.000	12.000	
iShsV-S&P 500 FinI Sec.U.ETF Registered Shares USD (Acc) oN	IE00B4JNQZ49	ANT	150.300	150.300	
iShsVII-MSCI Bra.U.ETF USD Acc Registered Shares o.N.	IE00B59L7C92	ANT	8.800	8.800	
Magna Umbrella Fd.-MENA FUND Registered Shares Class N o.N.	IE00B3QPMN62	ANT	11.250	11.250	
ME Fonds-Special Values Inhaber-Anteile B o.N.	LU1377969701	ANT	-	2.125	
MLIS - Marshall Wace Tops Ucits III Fund B Acc Eur	LU0333226826	ANT	-	5.020	
US Bond Opp. 2021 Actions au Port.J1 C.4 Déc.oN	FR0013233772	ANT	-	5.210	
Vates - inprimo Parade Inhaber-Anteile A o.N.	LU1098509851	ANT	20.200	50.700	
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: 10Yr. United States of America Treasury Note synth. Anleihe		USD			2.053,98
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
Basiswert: DAX Index		EUR			42.777,27
Basiswert: CBOE VOLATILITY IND.		USD			99,38
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: DAX Index		EUR			43.951,95
Basiswert: Nasdaq-100 Index		USD			1.801,25
Devisenterminkontrakte (Verkauf)					
Verkauf von Devisen auf Termin:					
GBP		EUR			202,09
USD		EUR			1.606,78

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

für den Zeitraum vom 01. September 2017 bis 31. August 2018	3ik-Strategiefonds II Class I		3ik-Strategiefonds II Class R	
I. Erträge				
1. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	-5.391,42*)		-49,61*)
2. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	52.795,66		469,71
3. Sonstige Erträge 1)	EUR	18.107,64		164,20
Summe der Erträge	EUR	65.511,88		584,30
II. Aufwendungen				
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR	188,94**)		1,89**)
2. Verwaltungsvergütung	EUR	-192.269,03		-2.119,87
3. Verwahrstellenvergütung	EUR	-8.734,98		-78,52
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR	-11.937,09		-315,74
5. Sonstige Aufwendungen 2)	EUR	-1.580,60		-21,57
Summe der Aufwendungen	EUR	-214.332,76		-2.533,81
III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	-148.820,88		-1.949,51
IV. Veräußerungsgeschäfte				
1. Realisierte Gewinne	EUR	787.773,89		7.039,57
2. Realisierte Verluste	EUR	-677.350,22		-6.087,45
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	110.423,67		952,12
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres				
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	746.390,80		6.742,38
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-212.980,87		-1.607,34
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	533.409,93		5.135,04
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	495.012,72		4.137,65

*) Der Sollsaldo resultiert aus negativen Habenzinsen

**) Der Habensaldo resultiert aus zu hohen Rückstellungen zum letzten Geschäftsjahresende

Entwicklung des Investmentvermögens 2018

	3ik-Strategiefonds II Class I		3ik-Strategiefonds II Class R	
I. Wert des Investmentvermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR	16.483.569,22	EUR	163.075,99
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR	-8.119,68	EUR	-15,53
2. Steuerabschlag zum 02.01.2018	EUR	-9.907,59	EUR	-57,40
3. Mittelzufluss / -abfluss (netto)	EUR	731.688,20	EUR	-9.531,25
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen:	EUR	2.177.080,24	EUR	6.539,51
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen:	EUR	-1.445.392,04	EUR	-16.070,76
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	-2.267,43	EUR	-26,73
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	495.012,72	EUR	4.137,65
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	746.390,80	EUR	6.742,38
davon nicht realisierte Verluste	EUR	-212.980,87	EUR	-1.607,34
II. Wert des Investmentvermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR	17.689.975,44	EUR	157.582,73

Verwendung der Erträge des Investmentvermögens

Berechnung der Ausschüttung	insgesamt	je Anteil *) **)
3ik-Strategiefonds II Class I		
I. Für die Ausschüttung verfügbar		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	EUR 0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR -38.397,21	-0,27
3. Zuführung aus dem Investmentvermögen ****)	EUR 677.350,22	4,81
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1. Der Wiederanlage zugeführt ***)	EUR -487.798,01	-3,47
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR -38.580,60	-0,27
III. Gesamtausschüttung	EUR 112.574,40	0,80
1. Endausschüttung		
a) Barausschüttung	EUR 112.574,40	0,80
3ik-Strategiefonds II Class R		
I. Für die Ausschüttung verfügbar		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	EUR 0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR -997,39	-0,68
3. Zuführung aus dem Investmentvermögen ****)	EUR 6.087,45	4,16
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1. Der Wiederanlage zugeführt ***)	EUR -4.338,33	-2,96
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR 419,47	0,29
III. Gesamtausschüttung	EUR 1.171,20	0,80
1. Endausschüttung		
a) Barausschüttung	EUR 1.171,20	0,80

*) Pflichtangabe gem. § 101 Abs. 1 Nr. 5 KAGB

**) bei Anteilklassen ist die Berechnung der Ausschüttung ggf. für jede Anteilklasse gesondert vorzunehmen.

***) Insbesondere wiederanzulegende Ergebnisse aus Geschäften mit Finanzinstrumenten sowie weitere wiederanzulegende Veräußerungsgewinne und/oder ordentliche Ertragsteile

****) Die Zuführung aus dem Investmentvermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten (für die Ausschüttung notwendig wäre eine Zuführung i.H.v. EUR 0,00)

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert	
3ik-Strategiefonds II Class I				
2015	EUR	20.917.784,19	EUR	119,35
2016	EUR	18.704.220,27	EUR	116,84
2017	EUR	16.483.569,22	EUR	122,24
2018	EUR	17.689.975,44	EUR	125,71
3ik-Strategiefonds II Class R				
2015	EUR	146.893,09	EUR	103,30
2016	EUR	146.969,67	EUR	100,66
2017	EUR	163.075,99	EUR	105,01
2018	EUR	157.582,73	EUR	107,64

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 2.926.839,89

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Donner & Reuschel AG

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	99,36
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,14

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Investmentvermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz anhand eines Vergleichsvermögens ermittelt.

Angaben nach dem qualifizierten Ansatz

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. § 37 Abs. 4 DerivateV

kleinster potentieller Risikobetrag	0,38 %
größter potentieller Risikobetrag	1,01 %
durchschnittlicher potentieller Risikobetrag	0,68 %

Risikomodell, das gemäß § 10 DerivateV verwendet wurde

Full-Monte-Carlo

Parameter, die gemäß § 11 DerivateV verwendet wurden

99% Konfidenzniveau, 1 Tage Haltedauer bei einem effektiven historischen Beobachtungszeitraum von einem Jahr

Im Geschäftsjahr erreichter durchschnittlicher Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte

Mittelwert	1,11
------------	------

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens § 37 Abs. 5 DerivateV

MSCI - World Index	50,00 %
iBoxx EUR Corporates Total Return Index in EUR	30,00 %
REX Performance Index	20,00 %

Sonstige Angaben

Anteilwert - 3ik-Strategiefonds II Class I	EUR	125,71
Umlaufende Anteile	STK	140.718

Anteilwert - 3ik-Strategiefonds II Class R	EUR	107,64
Umlaufende Anteile	STK	1.464

Anteilklasse I: Verwaltungsvergütung 1,10% p.a.; Ertragsverwendung Ausschüttung

Anteilklasse R: Verwaltungsvergütung 1,35% p.a.; 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).

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote *)	
3ik-Strategiefonds II Class I	2,62 %
3ik-Strategiefonds II Class R	3,01 %

*) Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Investmentvermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Investmentvermögens aus

Transaktionskosten**) EUR 35.090,94

**) Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes 0,00 %

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

Gezahlte Verwaltungsvergütung (01.09.2017 - 31.08.2018)	EUR 194.388,90
Performance-Fee (01.09.2017 - 31.08.2018)	EUR 0,00

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.

Verwaltungsvergütungssatz für im Investmentvermögen gehaltene Investmentanteile

2) Die Verwaltungsvergütung für KVG-eigene Investmentanteile beträgt:

4Q-SPECIAL INCOME	0,5600% p.a.
4Q-VALUE FONDS	0,6000% p.a.
Apus Capital Revalue Fonds	1,8000% p.a.
Attila Global Opportunity Fund Inhaber-Anteile	1,6000% p.a.
TBF GLOBAL EQUITY LS Inhaber-Anteile EUR I	0,5200% p.a.
4Q-GROWTH FONDS	0,6000% p.a.

3) Die Verwaltungsvergütung für Gruppenfremde Investmentanteile beträgt:

ACEVO GI.Healthcare Abs.Ret.UI Inhaber-Anteile	1,8000% p.a.
AGIF V-Allianz Japan Small.Cos Inhaber-Anteile A EUR o.N.	2,0500% p.a.
Alpora Innovation Select Inhaber-Anteilsklasse I	2,2000% p.a.
Atlantis Intl Umb.-Japan Opp. Registered Shares EUR o.N.	1,5000% p.a.
Bellevue Fds (L)-BB Ada.DI He. Namens-Anteile I EUR o.N.	0,9000% p.a.
Bellevue Fds (Lux)-BB Afr.Opp. Namens-Anteile I EUR o.N.	0,9000% p.a.
Bellevue Fds(Lux)-BB Adm.H.In. Namens-Anteile I EUR o.N.	0,9000% p.a.
BILKU 1-OPAL Fonds Actions au Port. Cl.AL o.N.	0,2500% p.a.
Calibrate Total Return Inhaber-Anteile	0,2000% p.a.
db x-tr.Harv.CSI300 UCITS ETF Inhaber-Anteile 1D o.N.	0,8000% p.a.
ETFS DAXglbl Gold Min.GO UCITS	0,6500% p.a.
FCP OP MEDICAL BIOHEALTH-TRENDS I (EUR)	1,9000% p.a.
GREIFF 'spec.situations' Fd OP Inh.-Anteile	1,7000% p.a.
H2O Allegro Act. au Port. I (4 Déc.) o.N.	0,7000% p.a.
ICBCCS WisdomTree S&P China500 Actions Nominatives B USD o.N.	0,7500% p.a.
IP Fonds-IP White T	1,0000% p.a.
iSh.ST.Eu.600 Bas.Res.U.ETF DE	0,4500% p.a.
Jupiter Gl.Fd-J.Europ.Abs.Ret. Namens-Ant. L EUR A Acc.o.N.	1,7500% p.a.
LOYS Global MH	1,1000% p.a.
Lupus alpha Fds-Glo.Conver.Bds Namens-Anteile C Hdgd o.N.	1,0000% p.a.
nova Steady HealthCare Inhaber-Anteile I EUR (dist.)	2,5000% p.a.
Palad.A.M.I.AG TGV-Paladin One Inhaber-Anlageaktien	1,5000% p.a.
ProfitlichSchmidlin Fonds UI Inhaber-Anteile Ant.klasse I	1,2500% p.a.
QanTRADE Adaptive L/S Strat.UI Inhaber-Anteilsklasse I	2,5000% p.a.
Struct.Sols-Lithium Index Str. Namens-Anteile o.N.	0,1500% p.a.
TAMAC Qilin-China Champions. Actions Nom.D EUR (INE) o.N.	2,0000% p.a.

Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeaufschläge wurden nicht berechnet.

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

1) Erträge aus Kick-Back Zahlungen

2) Im Wesentlichen Gebühren für die BaFin, Aufwandsausgleich

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nicht realisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nicht realisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

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 sind finanzielle Anreizsysteme für variable Vergütungen 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.

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.

Angaben zur Mitarbeitervergütung im Auslagerungsfall für das Geschäftsjahr 2016/2017 (Portfoliomanagement Gies & Heimburger GmbH)

Die KVG zahlt keine direkten Vergütungen an Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens.

Das Auslagerungsunternehmen hat folgende Informationen an uns übermittelt:

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr des Auslagerungsunternehmens gezahlten Mitarbeitervergütung:	EUR	556.000
davon feste Vergütung:	EUR	551.800
davon variable Vergütung:	EUR	4.200
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen:	EUR	0

Zahl der Mitarbeiter des Auslagerungsunternehmens: 11

Hamburg, 14. November 2018

HANSAINVEST
Hanseatische Investment-GmbH
Geschäftsführung

(Nicholas Brinckmann) (Marc Drießen) (Dr. Jörg W. Stotz)

Wiedergabe des Vermerks des Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft mit beschränkter Haftung, Hamburg

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft mit beschränkter Haftung hat uns beauftragt, gemäß § 102 des Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) den Jahresbericht des Investmentvermögens 3ik-Strategiefonds II für das Geschäftsjahr vom 1. September 2017 bis 31. August 2018 zu prüfen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter

Die Aufstellung des Jahresberichts nach den Vorschriften des KAGB liegt in der Verantwortung der gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft.

Verantwortung des Abschlussprüfers

Unsere Aufgabe ist es, auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfung eine Beurteilung über den Jahresbericht abzugeben.

Wir haben unsere Prüfung nach § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung vorgenommen. Danach ist die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass Unrichtigkeiten und Verstöße, die sich auf den Jahresbericht wesentlich auswirken, mit hinreichender Sicherheit erkannt werden. Bei der Festlegung der Prüfungshandlungen werden die Kenntnisse über die Verwaltung des Investmentvermögens sowie die Erwartungen über mögliche Fehler berücksichtigt. Im Rahmen der Prüfung werden die Wirksamkeit des rechnungslegungsbezogenen internen Kontrollsystems und die Nachweise für die Angaben im Jahresbericht überwiegend auf der Basis von Stichproben beurteilt. Die Prüfung umfasst die Beurteilung der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze für den Jahresbericht und der wesentlichen Einschätzungen der gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine hinreichend sichere Grundlage für unsere Beurteilung bildet.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der Jahresbericht für das Geschäftsjahr vom 1. September 2017 bis 31. August 2018 den gesetzlichen Vorschriften.

Hamburg, den 15. November 2018

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Gero Martens ppa. Ruth Koddebusch
Wirtschaftsprüfer Wirtschaftsprüferin

Besteuerung der Wiederanlage

HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

Besteuerungsgrundlagen gemäß § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und Nr. 2 InvStG

Geschäftsjahr vom 01.09.2017 bis 31.12.2017

Steuerlicher Zufluss: 31.12.2017

Name des Investmentfonds: 3ik-Strategiefonds II Class I

ISIN: DE000A1H44J2

§ 5 Abs. 1 S. 1 Nr. InvStG		Privatvermögen EUR je Anteil	Betriebsvermögen KStG ¹⁾ EUR je Anteil	Sonst. Betriebsvermögen ²⁾ EUR je Anteil
2)	Betrag der Thesaurierung/ ausschüttungsgleichen Erträge	0,2514700	0,2514700	0,2514700
1 c)	In der Thesaurierung enthaltene			
	aa) Erträge i.S.d. § 2 Abs. 2 S. 1 i.V.m. § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG ⁴⁾	-	-	0,2127900
	cc) Erträge i.S.d. § 2 Abs. 2a (Zinsschranke)	-	0,0393300	0,0393300
	gg) Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 1	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	hh) in 1 c gg) enthaltene Einkünfte, die nicht dem Progressionsvorbehalt unterliegen	0,0000000	-	0,0000000
	ii) Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2, auf die tatsächlich ausländische Quellensteuer einbehalten wurde oder als einbehalten gilt, für die kein Abzug nach Abs. 4 vorgenommen wurde	0,1234000	0,1234000	0,1234000
	jj) in 1 c ii) enthaltene Einkünfte, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,1112300
	kk) in 1 c ii) enthaltene Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2, die nach einem DBA zur Anrechnung einer als gezahlt geltenden Steuer auf die Einkommensteuer oder Körperschaftsteuer berechnen	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	ll) in 1 c kk) enthaltene Einkünfte, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0000000
1 d)	zur Anrechnung von Kapitalertragsteuer berechtigender Teil der Erträge			
	aa) i.S.d. § 7 Abs. 1 und 2	0,2514700	0,2514700	0,2514700
	bb) i.S.d. § 7 Abs. 3	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	davon inländische Mieterträge	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	cc) i.S.d. § 7 Abs. 1 S. 4, soweit in 1 d aa) enthalten	0,2142000	0,2142000	0,2142000
1 f)	Betrag der ausländischen Steuer, der auf die in den Erträgen enthaltenen Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2 entfällt, und			
	aa) der nach § 4 Abs. 2 i.V.m. § 32d Abs. 5 oder § 34c Abs. 1 EStG oder einem DBA anrechenbar ist, wenn kein Abzug nach § 4 Abs. 4 vorgenommen wurde ⁵⁾	0,0282375	0,0472500	0,0472500
	bb) in 1 f aa) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0468200
	cc) der nach § 4 Abs. 2 i.V.m. § 34c Abs. 3 EStG abziehbar ist, wenn kein Abzug nach § 4 Abs. 4 vorgenommen wurde	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	dd) in 1 f cc) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0000000
	ee) der nach einem DBA als gezahlt gilt und nach § 4 Abs. 2 i.V.m. diesem Abkommen anrechenbar ist ⁵⁾	0,0000000	0,0000900	0,0000900
	ff) in 1 f ee) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0000000
1 g)	Betrag der Absetzungen für Abnutzung oder Substanzverringerung	0,0000000	0,0000000	0,0000000
1 h)	die im Geschäftsjahr gezahlte Quellensteuer, vermindert um die erstattete Quellensteuer des Geschäftsjahres oder früherer Geschäftsjahre ⁶⁾	0,0587700	0,0587700	0,0587700

Steuerlicher Anhang:

- Angaben für Anleger, die nach dem KStG besteuert werden. Bei den Angaben ist zu beachten, dass § 8b Abs. 1 bis 6 KStG für Anleger, die bestimmte Körperschaften sind, keine Anwendung findet. Die Anwendbarkeit vorgenannter Vorschriften kann auch Einfluss auf die Anrechenbarkeit ausländischer Quellensteuern haben.
- Angaben für Anleger, die ihre Anteile im Betriebsvermögen halten und nach dem EStG besteuert werden (z.B. Einzelunternehmer oder Mitunternehmer in gewerblichen Personengesellschaften).
- N.A.
- Die Einkünfte sind zu 100 % ausgewiesen.
- Der Ausweis der ausländischen anrechenbaren (fiktiven) Quellensteuer erfolgt beim Privatanleger unter Beachtung der Höchstbetragsberechnung.
- Der Ausweis der gezahlten Quellensteuer des aktuellen Geschäftsjahres vermindert um die erstattete Quellensteuer aus Vorjahren nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 h) InvStG erfolgt unter Berücksichtigung der auf Fondsebene bereits nach § 4 Abs. 4 InvStG als Werbungskosten abgezogenen anrechenbaren ausländischen Quellensteuer. Soweit die erstattete Quellensteuer die gezahlte Quellensteuer übersteigt, erfolgt der Ausweis als negativer Betrag.

HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

Besteuerungsgrundlagen gemäß § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und Nr. 2 InvStG

Geschäftsjahr vom 01.09.2017 bis 31.12.2017

Steuerlicher Zufluss: 31.12.2017

Name des Investmentfonds: 3ik-Strategiefonds II Class R

ISIN: DE000A1H44K0

§ 5 Abs. 1 S. 1 Nr. InvStG		Privatvermögen EUR je Anteil	Betriebsvermögen KStG ¹⁾ EUR je Anteil	Sonst. Betriebsvermögen ²⁾ EUR je Anteil
2)	Betrag der Thesaurierung/ ausschüttungsgleichen Erträge	0,1290500	0,1290500	0,1290500
1 c)	In der Thesaurierung enthaltene			
	aa) Erträge i.S.d. § 2 Abs. 2 S. 1 i.V.m. § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG ⁴⁾	-	-	0,0875100
	cc) Erträge i.S.d. § 2 Abs. 2a (Zinsschranke)	-	0,0244600	0,0244600
	gg) Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 1	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	hh) in 1 c gg) enthaltene Einkünfte, die nicht dem Progressionsvorbehalt unterliegen	0,0000000	-	0,0000000
	ii) Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2, auf die tatsächlich ausländische Quellensteuer einbehalten wurde oder als einbehalten gilt, für die kein Abzug nach Abs. 4 vorgenommen wurde	0,0581800	0,0581800	0,0581800
	jj) in 1 c ii) enthaltene Einkünfte, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0510800
	kk) in 1 c ii) enthaltene Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2, die nach einem DBA zur Anrechnung einer als gezahlt geltenden Steuer auf die Einkommensteuer oder Körperschaftsteuer berechneten	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	ll) in 1 c kk) enthaltene Einkünfte, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0000000
1 d)	zur Anrechnung von Kapitalertragsteuer berechtigender Teil der Erträge			
	aa) i.S.d. § 7 Abs. 1 und 2	0,1290500	0,1290500	0,1290500
	bb) i.S.d. § 7 Abs. 3	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	davon inländische Mieterträge	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	cc) i.S.d. § 7 Abs. 1 S. 4, soweit in 1 d aa) enthalten	0,0883300	0,0883300	0,0883300
1 f)	Betrag der ausländischen Steuer, der auf die in den Erträgen enthaltenen Einkünfte i.S.d. § 4 Abs. 2 entfällt, und			
	aa) der nach § 4 Abs. 2 i.V.m. § 32d Abs. 5 oder § 34c Abs. 1 EStG oder einem DBA anrechenbar ist, wenn kein Abzug nach § 4 Abs. 4 vorgenommen wurde ⁵⁾	0,0130000	0,0269500	0,0269500
	bb) in 1 f aa) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0267200
	cc) der nach § 4 Abs. 2 i.V.m. § 34c Abs. 3 EStG abziehbar ist, wenn kein Abzug nach § 4 Abs. 4 vorgenommen wurde	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	dd) in 1 f cc) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0000000
	ee) der nach einem DBA als gezahlt gilt und nach § 4 Abs. 2 i.V.m. diesem Abkommen anrechenbar ist ⁶⁾	0,0000000	0,0000500	0,0000500
	ff) in 1 f ee) enthalten ist und auf Einkünfte entfällt, auf die § 2 Abs. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG oder im Fall des § 16 i.V.m. § 8b Abs. 1 KStG anzuwenden ist	-	-	0,0000000
1 g)	Betrag der Absetzungen für Abnutzung oder Substanzverringerung	0,0000000	0,0000000	0,0000000
1 h)	die im Geschäftsjahr gezahlte Quellensteuer, vermindert um die erstattete Quellensteuer des Geschäftsjahres oder früherer Geschäftsjahre ⁶⁾	0,0331500	0,0331500	0,0331500

Steuerlicher Anhang:

1) Angaben für Anleger, die nach dem KStG besteuert werden. Bei den Angaben ist zu beachten, dass § 8b Abs. 1 bis 6 KStG für Anleger, die bestimmte Körperschaften sind, keine

1) Angaben für Anleger, die nach dem KStG besteuert werden. Bei den Angaben ist zu beachten, dass § 8b Abs. 1 bis 6 KStG für Anleger, die bestimmte Körperschaften sind, keine Anwendung findet. Die Anwendbarkeit vorgenannter Vorschriften kann auch Einfluss auf die Anrechenbarkeit ausländischer Quellensteuern haben.

2) Angaben für Anleger, die ihre Anteile im Betriebsvermögen halten und nach dem EStG besteuert werden (z.B. Einzelunternehmer oder Mitunternehmer in gewerblichen Personengesellschaften).

3) N.A.

4) Die Einkünfte sind zu 100 % ausgewiesen.

5) Der Ausweis der ausländischen anrechenbaren (fiktiven) Quellensteuer erfolgt beim Privatanleger unter Beachtung der Höchstbetragsberechnung.

6) Der Ausweis der gezahlten Quellensteuer des aktuellen Geschäftsjahres vermindert um die erstattete Quellensteuer aus Vorjahren nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 h) InvStG erfolgt unter Berücksichtigung der auf Fondsebene bereits nach § 4 Abs. 4 InvStG als Werbungskosten abgezogenen anrechenbaren ausländischen Quellensteuer. Soweit die erstattete Quellensteuer die gezahlte Quellensteuer übersteigt, erfolgt der Ausweis als negativer Betrag.

Bescheinigung nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 InvStG

HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

Bescheinigung über die Angaben i.S.d. § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 InvStG für die vorstehenden Investmentfonds für den genannten Zeitraum

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH (nachfolgend: die Gesellschaft):

Die Gesellschaft hat uns beauftragt, gemäß § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 Investmentsteuergesetz (InvStG) zu prüfen, ob die von der Gesellschaft für die oben genannten Investmentfonds für den genannten Zeitraum (steuerliches Rumpfgeschäftsjahr) zu veröffentlichenden Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden. Die Bescheinigung hat zudem eine Aussage darüber zu enthalten, ob Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO vorliegen, der sich auf die Besteuerungsgrundlagen nach § 5 Abs. 1 InvStG oder auf die Aktiengewinne nach § 5 Abs. 2 Satz 1 InvStG auswirken kann, die für den Zeitraum veröffentlicht wurden, auf den sich die Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen.

Die Verantwortung für die Ermittlung der steuerlichen Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG in Verbindung mit den Vorschriften des deutschen Steuerrechts liegt bei den gesetzlichen Vertretern der Gesellschaft. Die Gesellschaft hat für alle von ihr verwalteten Investmentfonds, für die nach § 56 Abs. 1 S. 3 InvStG 2018 ein Rumpfgeschäftsjahr zu bilden ist, zur Ermittlung der zum 31. Dezember 2017 zuzurechnenden ausschüttungsgleichen Erträge sowie der anderen steuerlichen Angaben nach § 5 Abs. 1 InvStG gemäß Tz. 13 des BMF-Schreibens vom 8. November 2017 (IV C 1 -

S 1980-1/16/10010:010) ein vereinfachtes Verfahren angewandt. In die steuerlichen Angaben sind Werte aus einem Ertragsausgleich eingegangen.

Unsere Aufgabe ist es, auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfung eine Beurteilung abzugeben, ob die von der Gesellschaft nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 InvStG zu veröffentlichenden Angaben in Übereinstimmung mit den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden. Es ist nicht Teil unserer Aufgabe, zu überprüfen, ob die bei Anwendung des vereinfachten Verfahrens ermittelten Werte von den tatsächlichen Werten abweichen und ob die Gesellschaft für den Investmentfonds ein gegebenenfalls erforderliches Korrekturverfahren nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nummer 5 ff. InvStG 2004 oder § 13 Abs. 4a und 4b InvStG 2004 durchgeführt hat.

Wir haben unsere Prüfung unter sinnge-
mäßiger Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung vorgenommen. Danach ist die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass mit hinreichender Sicherheit beurteilt werden kann, ob die Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG frei von wesentlichen Fehlern sind. Bei der Festlegung der Prüfungshandlungen werden die Kenntnisse über die Verwaltung des Investmentfonds sowie die Erwartungen über mögliche Fehler berücksichtigt. Im Rahmen der Prüfung berücksichtigen wir das für die Ermittlung der Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG relevante interne Kontrollsystem, um Prü-

fungshandlungen zu planen und durchzuführen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.

Die Prüfung umfasst auch eine Beurteilung der Auslegung der angewandten Steuergesetze durch die Gesellschaft. Die von der Gesellschaft gewählte Auslegung ist dann nicht zu beanstanden, wenn sie in vertretbarer Weise auf Gesetzesbegründungen, Rechtsprechung, einschlägige Fachliteratur und veröffentlichte Auffassungen der Finanzverwaltung gestützt werden konnte. Wir weisen darauf hin, dass eine künftige Rechtsentwicklung oder insbesondere neue Erkenntnisse aus der Rechtsprechung eine andere Beurteilung der von der Gesellschaft vertretenen Auslegung notwendig machen können.

Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine hinreichend sichere Grundlage für unsere Beurteilung bildet.

Für unsere Aussage, ob Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten, des Rechts nach § 42 AO vorliegen, der sich auf die Besteuerungsgrundlagen nach § 5 Abs. 1 InvStG auswirken kann, sind nach § 5 Abs. 1a Satz 3 InvStG keine über die Prüfung der Einhaltung der Regeln des deutschen Steuerrechts hinausgehenden Ermittlungen vorzunehmen. Für unsere Aussage, ob Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO vorliegen, der sich auf die

Aktiangewinne nach § 5 Abs. 2 Satz 1 InvStG auswirken kann, die für den Zeitraum veröffentlicht wurden, auf den sich die Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen, haben wir besondere Ermittlungen nur im Hinblick auf Vorgänge des laufenden Jahres vorgenommen. Unsere Aussage stützen wir auf analytische Prüfungshandlungen und Befragungen zu den veröffentlichten Aktiengewinnen und den veröffentlichten Rücknahmepreisen für den Berichtszeitraum.

Auf dieser Grundlage bescheinigen wir der Gesellschaft nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 InvStG, dass die Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden.

Es haben sich keine Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO ergeben, der sich auf die Besteuerungsgrundlagen nach § 5 Abs. 1 InvStG oder auf die Aktiengewinne nach § 5 Abs. 2 Satz 1 InvStG auswirken kann, die für den Zeitraum veröffentlicht wurden, auf den sich die Angaben nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen.

Es kann nicht ausgeschlossen werden, dass sich aus Sicht der Finanzverwaltung aus den von den Investmentfonds durchgeführten Geschäften oder sonstigen Umständen, insbesondere dem Abschluss von derivativen Geschäften, dem Kauf und Verkauf von Wertpapieren und anderen Vermögensgegenständen, dem

Bezug von Leistungen, durch die Werbungskosten entstehen, der Vornahme eines Ertragsausgleichs, der Entscheidung über die Ausschüttung von Erträgen, sowie deren Zusammenspiel (weitere) Anhaltspunkte für einen Missbrauch von Gestaltungsmöglichkeiten des Rechts nach § 42 AO ergeben.

Frankfurt am Main, den 21.02.2018

KPMG AG

Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Olaf J. Mielke, MBA Katrin Kiepke
Steuerberater Steuerberaterin

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:

DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 20.500.000,00
Eigenmittel (Art. 72 CRR):
€ 211.062.705,72
(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
www.hansainvest.de