

Jahresbericht zum 30. Juni 2018

Antecedo Strategic Invest

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Antecedo Strategic Invest

in der Zeit vom 01. Juli 2017 bis 30. Juni 2018.

Hamburg, im Oktober 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 30. Juni 2018	6
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	11
Wichtige Mitteilung an unsere Anleger	13
Wiedergabe des Vermerks des Abschlussprüfers	14
Besteuerung der Wiederanlage zum 31.12.2017	15
Bescheinigung nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 InvStG	16
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	18

Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr 2017/2018

Anlageziel und Anlagepolitik

Das Investmentvermögen **Antecedo Strategic Invest** strebt als Anlageziel auf mittlere bis lange Sicht die Erwirtschaftung eines Kapitalzuwachses an. Beabsichtigt ist die Investition in kurzlaufende internationale Anleihen hoher Bonität (Staatsanleihen, Pfandbriefe, etc.) kombiniert mit einer Optionsprämien- und Handelsstrategie. Die Gesamterträge der Strategie setzen sich zusammen aus der Basisverzinsung der Anleihen und den Ergebnissen der Optionsprämien- und Handelsstrategie. Die Optionsprämienstrategie ist die Kombination von gegenläufigen Derivatestrukturen auf Basis von Aktienindizes und Anleihen. Hierbei werden langlaufende Optionen gekauft und kurzlaufende Index-Optionen verkauft. Aus der kürzeren Fristigkeit der verkauften kurzen Optionen entsteht ein höherer Zeitwertverfall, wodurch eine attraktive Zusatzrendite erreicht werden soll. Die hiermit verbundene Handelsstrategie soll die Risiken bei Kursbewegungen in den Basisinstrumenten steuern, so dass die Strategie an Kursbewegungen partizipieren kann.

Für das Investmentvermögen können andere Wertpapiere (z. B. Anleihen, Genussscheine und Zertifikate, mit Ausnahme von Aktien), Geldmarktinstrumente, Bankguthaben, Anteile an anderen Investmentvermögen erworben werden.

In Schuldverschreibungen von nachfolgenden Ausstellern kann das Investmentvermögen mehr als 35 % seines Wertes anlegen: Bundesrepublik Deutschland, Frankreich, Niederlande und Finnland.

Für das Investmentvermögen dürfen Investmentanteile von bis zu 10 % des Wertes des Investmentvermögens erworben werden. Darüber hinaus ist der Erwerb von sonstigen Anlageinstrumenten mit Ausnahme von sonstigen Anlageinstrumenten gemäß § 198 Nr. 1 und 3 KAGB (max. 10 % des Wertes des Investmentvermögens) und Derivate zulässig. Derivate können zu Absicherungs-, Portfoliosteuerungszwecken und zur Erzielung von Zusatzerträgen eingesetzt werden.

Die maximalen Anlagegrenzen für die jeweiligen Vermögensgegenstände bezogen auf den Wert des Investmentvermögens stellen sich im Überblick gemäß nachfolgender Tabelle dar:

Verzinsliche Wertpapiere (auch Zertifikate):	Max. 100 %
Bankguthaben und Geldmarktinstrumente:	Max. 100 %
Aktienfondsanteile:	Max. 10 %
Rentenfondsanteile:	Max. 10 %
Geldmarktfondsanteile:	Max. 10 %

Insgesamt dürfen für das Investmentvermögen maximal 10 % des Wertes des Investmentvermögens in Anteilen an in- oder ausländischen Investmentvermögen angelegt werden.

Aktien und Aktien gleichwertige Wertpapiere dürfen für das Investmentvermögen nicht erworben werden.

Das Marktrisiko potential beträgt maximal 200 %. Die Fondswährung lautet auf Euro.

Portfoliostruktur

Im Berichtszeitraum investierte der Fonds innerhalb der vorgegebenen Anlagegrenzen in folgende Wertpapierarten bzw. Derivate:

- Aktienindex-Futures und -Optionen
- Volatilitäts-Futures
- Zins-Futures
- Publikumsfonds
- Festverzinsliche Anleihen
- Devisentermingeschäfte

Veräußerungsergebnisse

Für den Berichtszeitraum betrug das Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften des **Antecedo Strategic Invest**:

EUR – 5.433.145,69

Das Veräußerungsergebnis resultiert aus Gewinnen in Höhe von 9.030.579,58 EUR und Verluste in Höhe von 14.463.725,27 EUR.

Die hohen Veräußerungsverluste resultieren aus den Optionen und Futures des amerikanischen Volatilitätsindex (VIX Index), in die der Fonds investiert war. Die Strategie des Fonds war darauf ausgelegt, durch historisch normale Kursveränderungen dieses Index Gewinne zu erzielen. In den letzten beiden Jahren traten entweder nur sehr geringe oder extrem hohe Kursschwankungen auf. Hierdurch entstanden im Fonds Verluste. Auf Grund des fortwährend abnormalen Kursverhaltens des VIX Index wurde diese Strategie beendet.

Das Veräußerungsergebnis wurde im Wesentlichen durch Transaktionen im Bereich der Finanzterminkontrakte und verzinslichen Wertpapieren erzielt.

Risikoanalyse

Für den Berichtszeitraum weist der Fonds **Antecedo Strategic Invest** eine Wertentwicklung von -36,37 % aus.

Die Volatilität des Investmentvermögens betrug im Berichtsjahr 45,09 %.

Adressausfallrisiken:

Hinsichtlich eines Adressatenrisikos achtet das Fondsmanagement bewusst auf eine breite Diversifizierung und erwirbt nur Anleihen erstklassiger Bonität.

Marktpreisrisiken /

Zinsänderungsrisiken:

Das zentrale Marktpreisrisiko des Fonds resultiert aus der Wertentwicklung und den Kursbewegungen der Wertpapiere und Derivate. Es wurden in geringem Maße Zinsänderungsrisiken eingegangen

durch den Erwerb von Staatspapieren, Pfandbriefen u. ä.

Währungsrisiken:

Die zeitweise aus dem USD resultierenden Währungsrisiken wurden durch den Einsatz von Devisentermingeschäften weitestgehend neutralisiert.

Operationelle Risiken:

Besondere operationelle Risiken waren im Berichtszeitraum nicht zu verzeichnen.

Liquiditätsrisiken:

Besondere Liquiditätsrisiken waren im Berichtszeitraum nicht zu verzeichnen.

Volatilitätsrisiken

Besondere Volatilitätsrisiken waren im Berichtszeitraum nicht zu verzeichnen.

Sonstige Hinweise

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

Das Verwaltungs- und Verfügungsrecht über das Sondervermögen Antecedo Strategic Invest ist von der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH auf die HSBC INKA mit Wirkung zum 01.07.2018, 00:00 Uhr übertragen worden. Zeitgleich ist ebenfalls die Verwahrstellenfunktion von der BNP PARIBAS Securities Services S.C.A., Zweigniederlassung Frankfurt am Main, auf die HSBC Trinkaus & Burkhardt AG, Düsseldorf übergegangen.

Das Portfoliomanagement für den **Antecedo Strategic Invest** ist an die Antecedo Asset Management GmbH ausgelagert.

Weitere für den Anleger wesentliche Ereignisse haben sich nicht ergeben.

Vermögensaufstellung per 30. Juni 2018

Fondsvermögen: EUR 679.236,32 (3.958.329,70)

Umlaufende Anteile: Stück 960 (3.560)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	
I. Vermögensgegenstände			
1. Anleihen	573	84,36	(89,64)
2. Sonstige Wertpapiere	56	8,29	(8,77)
3. Derivate	0	0,00	(-7,42)
4. Bankguthaben	68	10,05	(18,24)
5. Sonstige Vermögensgegenstände	1	0,08	(0,08)
II. Verbindlichkeiten			
	-19	-2,78	(-9,31)
III. Fondsvermögen			
	679	100,00	

(Angaben in Klammern per 30.06.2017)

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge		Ver- käufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum						
Börsengehandelte Wertpapiere											
Verzinsliche Wertpapiere											
1,000000000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.168 v.2014(19)	DE0001141687		EUR	150	250	600	%	101,099000	151.648,50	22,33	
0,000000000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.16(18)	DE0001104651		EUR	100	400	800	%	100,137500	100.137,50	14,74	
0,000000000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.16(18)	DE0001104669		EUR	200	200	500	%	100,281500	200.563,00	29,53	
0,000000000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.17(19)	DE0001104677		EUR	100	100	0	%	100,492500	100.492,50	14,79	
Summe der börsengehandelten Wertpapiere									EUR	552.841,50	81,39
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere											
Verzinsliche Wertpapiere											
0,500000000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.169 v.14/19	DE0001141695		EUR	20	0	980	%	100,936000	20.187,20	2,97	
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere									EUR	20.187,20	2,97
Investmentanteile											
Gruppenfremde Investmentanteile 2)											
Antecedo Euro Yield Inhaber-Anteile A	DE000A1J6B01		ANT	500	4.700	4.200	EUR	112,560000	56.280,00	8,29	
Summe der Investmentanteile									EUR	56.280,00	8,29
Summe Wertpapiervermögen									EUR	629.308,70	92,65
Bankguthaben											
EUR - Guthaben bei:											
Verwahrstelle: BNP Paribas Securities Service SCA			EUR	68.236,66					68.236,66	10,05	
Summe der Bankguthaben									EUR	68.236,66	10,05
Sonstige Vermögensgegenstände											
Zinsansprüche			EUR	543,29					543,29	0,08	
Summe sonstige Vermögensgegenstände									EUR	543,29	0,08
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-18.852,33			EUR		-18.852,33	-2,78	
Fondsvermögen									EUR	679.236,32	100*)
Anteilwert									EUR	707,54	
Umlaufende Anteile									STK	960	

Fußnoten:

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

1) noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwaltungsvergütung, Give Up Gebühren

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 0,00 EUR.

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. Wgh. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,000000000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.16(18)	DE0001104644	EUR	-	500	
0,250000000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.166 v.13/18	DE0001141661	EUR	1.000	1.500	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
Antecedo Convex Invest Inhaber-Anteile	DE000A1WZ389	ANT	-	3.500	
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
Basiswert: VSTOXX Index		EUR			2.408,88
Basiswert: CBOE VOLATILITY IND.		USD			19.199,24
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: VSTOXX Index		EUR			686,32
Basiswert: CBOE VOLATILITY IND.		USD			4.482,49
Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices:					
Gekaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: CBOE VOLATILITY IND.		USD			14.089,26
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: CBOE VOLATILITY IND.		USD			9.017,86
Verkaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: CBOE VOLATILITY IND.		USD			6.949,10
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: CBOE VOLATILITY IND.		USD			8.642,78
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte:					
Gekaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: VSTOXX Mini Index Futures		EUR			125,28
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: VSTOXX Mini Index Futures		EUR			3.024,42
Verkaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: VSTOXX Mini Index Futures		EUR			7,92
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: VSTOXX Mini Index Futures		EUR			3.654,69

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

für den Zeitraum vom 01. Juli 2017 bis 30. Juni 2018

I. Erträge

1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	EUR	8.294,57
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	-1.157,67*)
3. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	483,92
Summe der Erträge	EUR	7.620,82

II. Aufwendungen

1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR	-704,00
2. Verwaltungsvergütung	EUR	-55.998,85
3. Verwahrstellenvergütung	EUR	-10.921,74
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR	-9.787,03
5. Sonstige Aufwendungen 1)	EUR	-19.325,43
Summe der Aufwendungen	EUR	-96.737,05

III. Ordentlicher Nettoertrag

EUR -89.116,23

IV. Veräußerungsgeschäfte

1. Realisierte Gewinne	EUR	9.030.579,58
2. Realisierte Verluste	EUR	-14.463.725,27
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	-5.433.145,69

V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres

EUR -5.522.261,92

1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	-793.468,82
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	233.697,36

VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres

EUR -559.771,46

VII. Ergebnis des Geschäftsjahres

EUR -6.082.033,38

*) Der Sollsaldo resultiert aus negativen Habenzinsen

Entwicklung des Investmentvermögens

		2018
I. Wert des Investmentvermögens am Beginn des Geschäftsjahres		EUR 3.958.329,70
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)		EUR -1.387.378,77
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen:	EUR 2.667.087,50	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen:	EUR -4.054.466,27	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		EUR 4.190.318,77
3. Ergebnis des Geschäftsjahres		EUR -6.082.033,38
davon nicht realisierte Gewinne:	EUR -793.468,82	
davon nicht realisierte Verluste:	EUR 233.697,36	
II. Wert des Investmentvermögens am Ende des Geschäftsjahres		EUR 679.236,32

Verwendung der Erträge des Investmentvermögens

Berechnung der Wiederanlage	insgesamt		je Anteil *)
I. Für die Wiederanlage verfügbar			
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-5.522.261,92	-5.752,36
2. Zuführung aus dem Investmentvermögen **)	EUR	14.463.725,27	15.066,38
3. Zur Verfügung gestellter Steuerabzugsbetrag ***)	EUR	0,00	0,00
II. Wiederanlage	EUR	8.941.463,35	9.314,02

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

**) Die Zuführung aus dem Investmentvermögen resultiert aus der Berücksichtigung von realisierten Verlusten

***) Auf Grund der Neuregelung der Investmentbesteuerung wurde zum 31.12.2017 ein Steuerabzugsbetrag ermittelt und an das Finanzamt abgeführt.

Es handelt sich um einen Ergebnisbesteuerungsvorgang ohne investmentrechtliche Ergebnisverwendung.

Der Betrag errechnet sich auf Basis der umlaufenden Anteile zum Ende des Berichtszeitraumes.

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert
2015	EUR	13.577.288,18	EUR 1.614,81
2016	EUR	14.272.769,88	EUR 1.485,20
2017	EUR	3.958.329,70	EUR 1.111,89
2018	EUR	679.236,32	EUR 707,54

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

Deutsche Bank AG
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 92,65
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 0,00

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 0,02 %
größter potentieller Risikobetrag 20,79 %
durchschnittlicher potentieller Risikobetrag 2,96 %

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 erreichte durchschnittliche Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte

Mittelwert 4,27

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens § 37 Abs. 5 DerivateV

EUR FX-Cash 140,00 %
VSTOXX VOLATILITY INDEX -70,00 %
EURO STOXX 50 30,00 %

Sonstige Angaben

Anteilwert EUR 707,54
Umlaufende Anteile STK 960

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 *) 2,70 %

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

Transaktionskosten**) EUR 565.930,09

**) 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 (01.07.2017 - 30.06.2018)	EUR	55.998,85
Beratervergütung inkl. Performance-Fee (01.07.2017 - 30.06.2018)	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 Gruppenfremde Investmentanteile beträgt:

Antecedo Euro Yield Inhaber-Anteile A 0,4700% p.a.

Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeaufschläge wurden nicht berechnet.

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen:

1) Im Wesentlichen Depotgebühren, Kosten für die Markrisikomessung, 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

Hamburg, 01. Oktober 2018

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Geschäftsführung

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

Wichtige Mitteilung an unsere Anleger Übertragung der Verwaltung und Wechsel der Verwahrstelle Antecedo Strategic Invest (ISIN: DE000A0YJL93)

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH überträgt ihr Verwaltungsrecht an dem OGAW-Sondervermögen Antecedo Strategic Invest gemäß § 100 Abs. 1 Satz 1 des Kapitalanlagegesetzes (KAGB) in Verbindung mit § 22 Abs. 1 der Allgemeinen Anlagebedingungen mit Wirkung zum 1. Juli 2018, 00:00 Uhr auf die Internationale Kapitalanlagegesellschaft mbH, Düsseldorf.

Ferner wechselt für das oben genannte OGAW-Sondervermögen ebenfalls mit Wirkung zum 1. Juli 2018, 00:00 Uhr die Verwahrstelle von der BNP PARIBAS Securities Services S.C.A. Zweigniederlassung Frankfurt am Main zu der HSBC Trinkaus & Burkhardt AG, Düsseldorf.

Aus dem Wechsel der Verwahrstelle entstehen den Anteilhabern keine Kosten.

Hamburg, den 6. Februar 2018

Die Geschäftsleitung

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 Antecedo Strategic Invest für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2017 bis 30. Juni 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. Juli 2017 bis 30. Juni 2018 den gesetzlichen Vorschriften.

Hamburg, den 2. Oktober 2018

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Lothar Schreiber 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 01.07.2017 bis 31.12.2017

Steuerlicher Zufluss: 31.12.2017

Name des Investmentfonds: Antecedo Strategic Invest

ISIN: DE000A0YJL93

§ 5 Abs. 1 S. 1 Nr. InvStG		Privatvermögen EUR je Anteil	Betriebsvermögen EUR je Anteil KStG ¹⁾	Sonst. Betriebsvermögen ²⁾ EUR je Anteil
2)	Betrag der Thesaurierung/ ausschüttungsgleichen Erträge	0,0000000	0,0000000	0,0000000
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⁾	-	-	0,0000000
	cc) Erträge i.S.d. § 2 Abs. 2a (Zinsschranke)	-	0,0000000	0,0000000
	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	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	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	-	-	0,0000000
	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	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	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	0,0000000	0,0000000	0,0000000
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⁾	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	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	-	-	0,0000000
	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	0,0000000	0,0000000
	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⁾	0,0000000	0,0000000	0,0000000

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.

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 deut-
schen Grundsätze ordnungsmäßiger Ab-
schlussprüfung vorgenommen. Danach
ist die Prüfung so zu planen und durchzu-
führen, 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 wer-
den die Kenntnisse über die Verwaltung
des Investmentfonds sowie die Erwartun-
gen 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 durchzu-
führen, die unter den gegebenen Umstän-
den angemessen sind, jedoch nicht mit
dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksam-
keit des internen Kontrollsystems der Ge-
sellschaft abzugeben.

Die Prüfung umfasst auch eine Beurtei-
lung der Auslegung der angewandten
Steuergesetze durch die Gesellschaft.
Die von der Gesellschaft gewählte Aus-
legung ist dann nicht zu beanstanden,
wenn sie in vertretbarer Weise auf Geset-
zesbegründungen, Rechtsprechung, ein-
schlägige Fachliteratur und veröffentliche
Auffassungen der Finanzverwaltung
gestützt werden konnte. Wir weisen da-
rauf hin, dass eine künftige Rechtsent-
wicklung oder insbesondere neue Er-
kenntnisse aus der Rechtsprechung eine
andere Beurteilung der von der Gesell-
schaft vertretenen Auslegung notwendig
machen können.

Wir sind der Auffassung, dass unsere
Prüfung eine hinreichend sichere Grund-
lage für unsere Beurteilung bildet.

Für unsere Aussage, ob Anhaltspunkte
für einen Missbrauch von Gestaltungs-
möglichkeiten, des Rechts nach § 42 AO
vorliegen, der sich auf die Besteuerungs-
grundlagen nach § 5 Abs. 1 InvStG aus-
wirken kann, sind nach § 5 Abs. 1a Satz 3
InvStG keine über die Prüfung der Einhal-
tung der Regeln des deutschen Steuer-
rechts hinausgehenden Ermittlungen vor-
zunehmen. 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
IDUNA Vereinigte Lebensversicherung
aG für Handwerk, Handel und Gewerbe,
Hamburg

Verwahrstelle:

BNP Paribas Securities Services S.C.A.
Zweigniederlassung Frankfurt am Main
Dotationskapital:
EUR 117,16 Mio.
BNP Paribas Securities Services S.C.A.
Haftendes Eigenkapital:
EUR 880,7 Mio.
(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