

Jahresbericht zum 31. Dezember 2015

Quant.Euro Long Variable

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Quant.Euro Long Variable

in der Zeit vom 07. Mai 2015 bis 31. Dezember 2015.

Hamburg, im April 2016

Mit freundlicher Empfehlung

Ihre HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

Nicholas Brinckmann

Marc Drießen

Dr. Jörg W. Stotz

So behalten Sie den **Überblick:**

Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr 2015	4
Vermögensaufstellung per 31. Dezember 2015	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	11
Wiedergabe des Vermerks des Abschlussprüfers	12
Besteuerung der Ausschüttung	13
Bescheinigung nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 InvStG	15
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	16

Tätigkeitsbericht für das Rumpfgeschäftsjahr 2015

Anlageziel und Anlagepolitik

Ziel des Quant.Euro Long Variable ist es, auf Jahressicht positive Erträge zu erzielen und gleichzeitig gegenüber dem DJ EuroStoxx 50 Index eine höhere Rendite zu erreichen.

Das Fondsmanagement beabsichtigt, eine quantitative Anlagestrategie auf Grundlage der Aktien des DJ EuroStoxx 50 Index (optional dividendenstarker Large Cap-Aktien mit hoher Korrelation zum DJ EuroStoxx 50 Index) sowie standardisierten DJ EuroStoxx 50 Index-Futures-Kontrakten (optional DAX30 Index-Futures- und FTSE100 Index-Futures-Kontrakten) zu verfolgen. Im Basisportfolio wird zu mind. 75 % des Nettoinventarwertes (NAV) des Fonds fortlaufend in Kassa-Aktien des DJ EuroStoxx 50 Index investiert. Der Investitionsgrad des Fonds wird durch den Einsatz von DJ EuroStoxx 50 Index-Futures variabel zwischen 0 % und + 100 % des NAV systematisch gesteuert. Die Umsetzung erfolgt dabei durch einen Kauf- ("Long") oder Verkaufs- (Short") Ansatz der Futures-Kontrakte. Die Bestimmung des täglichen Investitionsgrades ermittelt das Fondsmanagement auf Basis unterschiedlicher quantitativer Strategieelemente (momentumbasierte Trendanalyse, Regressionsverfahren, volatilitätsabhängige Verfahren).

Portfoliostruktur

Im Berichtszeitraum variierte der Investitionsgrad im Sondervermögen zwischen 0 % und 100 %. In der zweiten Jahreshälfte bewegte sich der Investitionsgrad überwiegend im Bereich zwischen 0 % und 50 %, so dass das Portfolio während dieser Zeit insgesamt sehr defensiv aufgestellt war.

Veräußerungsergebnisse

Die ausschließlich in Euro erzielten Veräußerungsergebnisse betragen im Berichtszeitraum EUR -1.271.364,79. Sie resultieren aus realisierten Erfolgen aus Futures Transaktionen sowie Feinabstimmungen in Aktien.

Risikoanalyse

Der Fonds erzielte im Berichtszeitraum eine Volatilität von 11,00 %.

Adressenausfallrisiken:

Die Ausfallrisiken in Aktien verteilen sich entsprechend der Gewichte des Euro Stoxx 50 Index auf die jeweiligen Emittenten der Aktien.

Das Ausfallrisiko bei den Euro Stoxx 50 Future Positionen ist durch das „central clearing“ einer CCP de facto ausgeschlossen.

Marktpreisrisiken:

Das zentrale Marktpreisrisiko des Sondervermögens liegt in der Wertentwicklung des Euro Stoxx 50 Index.

Operationelle Risiken:

Besondere operationelle Risiken waren im Berichtszeitraum nicht zu verzeichnen.

Liquiditätsrisiken:

Besondere Liquiditätsrisiken waren im Berichtszeitraum nicht zu verzeichnen.

Zinsänderungsrisiken:

Zinsänderungsrisiken hatten im Berichtszeitraum nur einen marginalen Einfluss auf die Fondspreisentwicklung.

Sonstige Hinweise

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

Das Portfoliomanagement für den Quant. Euro Long Variable ist an die Quant. Capital Management GmbH ausgelagert. Hierbei handelt es sich um ein nicht mit der HANSAINVEST GmbH verbundenes Unternehmen.

Wesentliche Ereignisse

Das Sondervermögen wurde zum 07. Mai 2015 neu aufgelegt.

Vermögensaufstellung per 31. Dezember 2015

Fondsvermögen: EUR 40.480.689,07

Umlaufende Anteile: Stück 447.200

Vermögensaufteilung in TEUR/%		
Aktien		
Inland	11.235	27,75
Ausland	23.564	58,21
Derivate	-458	-1,13
Barvermögen	2.842	7,02
sonstige Vermögensgegenstände	3327	8,22
sonstige Verbindlichkeiten	-29	-0,07
	40.481	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Air Liquide	FR0000120073		STK	5.650	5.650	0	EUR 105,600000	596.640,00	1,47
Airbus Group	NL0000235190		STK	9.314	9.314	0	EUR 63,050000	587.247,70	1,45
Allianz	DE0008404005		STK	7.432	7.432	0	EUR 165,000000	1.226.280,00	3,03
Anheuser-Busch InBev	BE0003793107		STK	12.455	12.455	0	EUR 116,700000	1.453.498,50	3,59
ASML Holding	NL0010273215		STK	6.069	6.069	0	EUR 84,090000	510.342,21	1,26
Assicurazioni Generali	IT0000062072		STK	21.972	21.972	0	EUR 17,050000	374.622,60	0,93
AXA	FR0000120628		STK	34.007	34.007	0	EUR 25,490000	866.838,43	2,14
Banco Bilbao	ES0113211835		STK	101.076	101.076	0	EUR 6,867000	694.088,89	1,71
BASF	DE000BASF111		STK	14.960	14.960	0	EUR 71,520000	1.069.939,20	2,64
Bayer	DE000BAY0017		STK	13.394	13.394	0	EUR 117,900000	1.579.152,60	3,90
Bayerische Motoren Werke	DE0005190003		STK	5.230	5.230	0	EUR 98,560000	515.468,80	1,27
Bco Santander Cen. Hisp.	ES0113900J37		STK	228.309	228.309	0	EUR 4,622000	1.055.244,20	2,61
BNP Paribas	FR0000131104		STK	18.103	18.103	0	EUR 53,100000	961.269,30	2,37
Carrefour	FR0000120172		STK	10.224	10.225	1	EUR 27,225000	278.348,40	0,69
Compagnie de Saint-Gobain	FR0000125007		STK	8.165	8.166	1	EUR 40,210000	328.314,65	0,81
Daimler	DE0007100000		STK	16.216	16.216	0	EUR 78,380000	1.271.010,08	3,14
Danone	FR0000120644		STK	9.730	9.730	0	EUR 63,140000	614.352,20	1,52
Deutsche Bank	DE0005140008		STK	21.136	21.136	0	EUR 22,725000	480.315,60	1,19
Deutsche Post	DE0005552004		STK	15.590	15.590	0	EUR 26,305000	410.094,95	1,01
Deutsche Telekom	DE0005557508		STK	50.329	50.329	0	EUR 16,970000	854.083,13	2,11
E.ON SE	DE000ENAG999		STK	32.542	32.542	0	EUR 8,924000	290.404,81	0,72
Enel	IT0003128367		STK	104.948	104.948	0	EUR 3,924000	411.815,95	1,02
Engie S.A.	FR0010208488		STK	26.369	26.369	0	EUR 16,535000	436.011,42	1,08
ENI	IT0003132476		STK	43.844	43.844	0	EUR 14,040000	615.569,76	1,52
Essilor Intl -Cie Génle Opt.	FR0000121667		STK	3.558	3.558	0	EUR 116,500000	414.507,00	1,02
Fresenius	DE0005785604		STK	6.350	6.350	0	EUR 66,480000	422.148,00	1,04
Iberdrola	ES0144580Y14		STK	93.855	93.855	0	EUR 6,588000	618.316,74	1,53
Industria de Diseño Textil	ES0148396007		STK	17.056	17.056	0	EUR 32,255000	550.141,28	1,36
ING	NL0000303600		STK	62.677	62.677	0	EUR 12,675000	794.430,98	1,96
Intesa Sanpaolo	IT0000072618		STK	232.811	232.811	0	EUR 3,132000	729.164,05	1,80
Kon. Philips	NL0000009538		STK	15.173	15.173	0	EUR 24,080000	365.365,84	0,90
L'Oréal	FR0000120321		STK	3.974	3.974	0	EUR 158,150000	628.488,10	1,55
LVMH	FR0000121014		STK	4.397	4.397	0	EUR 147,750000	649.656,75	1,60
Münchener Rückversicherung	DE0008430026		STK	2.512	2.512	0	EUR 186,600000	468.739,20	1,16
Nokia	FI0009000681		STK	59.746	59.746	0	EUR 6,625000	395.817,25	0,98
Orange	FR0000133308		STK	31.392	31.392	0	EUR 15,640000	490.970,88	1,21
Safran	FR0000073272		STK	5.220	5.220	0	EUR 63,790000	332.983,80	0,82
Sanofi-Aventis	FR0000120578		STK	19.570	19.570	0	EUR 80,100000	1.567.557,00	3,87
SAP	DE0007164600		STK	15.486	15.486	0	EUR 74,120000	1.147.822,32	2,84
Schneider Electric	FR0000121972		STK	9.524	9.524	0	EUR 54,310000	517.248,44	1,28
Siemens	DE0007236101		STK	12.768	12.768	0	EUR 90,850000	1.159.972,80	2,87
Société Générale	FR0000130809		STK	13.078	13.078	0	EUR 43,375000	567.258,25	1,40
Telefónica	ES0178430E18		STK	70.523	70.523	0	EUR 10,480000	739.081,04	1,83
Total S.A.	FR0000120271		STK	38.769	38.770	1	EUR 42,140000	1.633.725,66	4,04
UniCredit	IT0004781412		STK	90.405	90.405	0	EUR 5,200000	470.106,00	1,16
Unilever	NL0000009355		STK	25.323	25.323	0	EUR 40,540000	1.026.594,42	2,54

Vermögensaufstellung zum 31.12.2015

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2015	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
VINCI	FR0000125486		STK	8.478	8.478	0	EUR 59,500000	504.441,00	1,25
Vivendi	FR0000127771		STK	20.826	20.826	0	EUR 19,695000	410.168,07	1,01
Volkswagen Vorzugsaktien	DE0007664039		STK	2.512	2.512	0	EUR 135,350000	339.999,20	0,84
Andere Wertpapiere									
Unibail-Rodamco	FR0000124711		STK	1.570	1.570	0	EUR 237,600000	373.032,00	0,92
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	34.798.689,45	85,96
Summe Wertpapiervermögen							EUR	34.798.689,45	85,96
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-1				-420,00	0,00
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-1				-420,00	0,00
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-167				-71.810,00	-0,18
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-18				-7.560,00	-0,02
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-8				-3.120,00	-0,01
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-31				-13.020,00	-0,03
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-179				-69.810,00	-0,17
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-5				-2.100,00	-0,01
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-3				-1.260,00	0,00
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-3				-1.260,00	0,00
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-1				-420,00	0,00
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-100				-42.000,00	-0,11
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-19				-7.410,00	-0,02
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-8				-5.360,00	-0,01
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-76				-29.640,00	-0,07
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-5				-2.100,00	-0,01
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-58				-24.360,00	-0,06
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-3				-1.260,00	0,00
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-136				-81.600,00	-0,20
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-199				-77.610,00	-0,19
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-25				-15.000,00	-0,04
Dow Jones Euro Stoxx 50 Future 18.03.2016	DE0009652388		STK	-1				-250,00	0,00
Summe der Aktienindex-Derivate							EUR	-457.790,00	-1,13
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: State Street Bank GmbH			EUR	2.841.897,92				2.841.897,92	7,02
Summe der Bankguthaben							EUR	2.841.897,92	7,02
Sonstige Vermögensgegenstände									
Initial Margin			EUR	3.282.481,71				3.282.481,71	8,11
Dividendenansprüche			EUR	23.649,09				23.649,09	0,06
Quellensteueransprüche			EUR	20.635,55				20.635,55	0,05
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	3.326.766,35	8,22
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-28.874,65			EUR	-28.874,65	-0,07
Fondsvermögen							EUR	40.480.689,07	100*
Anteilwert - Quant.Euro Long Variable EB							EUR	90,52	
Umlaufende Anteile							STK	447.200	

Fußnoten:

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

1) noch nicht abgeführte Prüfungs- und Veröffentlichungskosten, Transaktionsgebühren, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Zinsen lfd. Konto
Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

XEUR EUREX DEUTSCHLAND

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Repsol	ES0173516115	STK	16.425	16.425	
RWE	DE0007037129	STK	7.848	7.848	
Andere Wertpapiere					
Banco Bilbao Vizcaya Argent. Anrechte	ES06132119B5	STK	101.076	101.076	
Iberdrola Anrechte	ES06445809A5	STK	93.855	93.855	
Repsol S.A. Anrechte	ES0673516961	STK	16.425	16.425	
Telefónica Anrechte	ES06784309A5	STK	70.523	70.523	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Andere Wertpapiere					
Banco Santander Anrechte	ES06139009N6	STK	228.309	228.309	
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
Basiswert: DJES 50 Index (Price) (EUR)		EUR			43.267,19
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: DJES 50 Index (Price) (EUR)		EUR			413.075,36

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

für den Zeitraum vom 07. Mai 2015 bis 31. Dezember 2015	Quant.Euro Long Variable EB	
I. Erträge		
1. Dividenden inländischer Aussteller	EUR	85.712,35
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	EUR	381.116,01
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	-397,00*)
4. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR	-56.289,56
5. Sonstige Erträge 1)	EUR	4.763,27
Summe der Erträge	EUR	414.905,07
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR	-12.498,87
2. Verwaltungsvergütung	EUR	-136.389,14
3. Verwahrstellenvergütung	EUR	-9.321,66
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR	-7.991,41
5. Sonstige Aufwendungen 2)	EUR	-4.280,56
Summe der Aufwendungen	EUR	-170.481,64
III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	244.423,43
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	EUR	6.884.518,51
2. Realisierte Verluste	EUR	-8.155.883,30
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	-1.271.364,79
V. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	-1.026.941,36
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	783.304,82
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-3.995.674,39
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	-3.212.369,57
VII. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	-4.239.310,93

*) Der Sollsaldo resultiert aus negativen Habenzinsen

Entwicklung des Sondervermögens 2015

	Quant.Euro Long Variable EB	
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	0,00
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)	EUR	44.720.000,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen:	EUR	44.720.000,00
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen:	EUR	0,00
2. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	-4.239.310,93
davon nicht realisierte Gewinne:	EUR	783.304,82
davon nicht realisierte Verluste:	EUR	-3.995.674,39
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	40.480.689,07

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Ausschüttung	insgesamt	je Anteil
Quant.Euro Long Variable EB		
I. Für die Ausschüttung verfügbar		
1. Vortrag aus dem Vorjahr	EUR 0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR -1.026.941,36	-2,30
3. Zuführung aus dem Sondervermögen ****)	EUR 8.155.883,30	18,24
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		
1. Der Wiederanlage zugeführt ***)	EUR -6.884.220,16	-15,39
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR 1.238,22	0,00
III. Gesamtausschüttung	EUR 245.960,00	0,55
1. Endausschüttung		
a) Barausschüttung	EUR 245.960,00	0,55

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

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

Für die Ermittlung der investmentsteuerlichen Besteuerungsgrundlagen wird eine Bescheinigung nach §5 InvStG erstellt.

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Quant.Euro Long Variable EB	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert	
Geschäftsjahr				
Auflage			EUR	100,00
2015	EUR	40.480.689,07	EUR	90,52

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 35.540.530,00

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Baader Bank AG
Interactive Brokers
State Street Bank GmbH

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	85,96
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-1,13

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

Sonstige Angaben

Anteilwert - Quant.Euro Long Variable EB	EUR	90,52
Umlaufende Anteile	STK	447.200

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung von Vermögenswerten, die an einer Börse zum amtlichen Markt zugelassen bzw. in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind, erfolgt zu den handelbaren Schlusskursen des vorhergehenden Börsentages gem. § 27 KARBV. Nicht notierte Rentenwerte und Schuldscheindarlehen werden mit Renditekursen bewertet. Investmentzertifikate werden zu den letzten veröffentlichten Rücknahmepreisen angesetzt.

Vermögenswerte, die weder an einer Börse zugelassen noch in einen organisierten Markt einbezogen sind oder für die ein handelbarer Kurs nicht verfügbar ist, werden mit von anerkannten Kursversorgern zur Verfügung gestellten Kursen bewertet. Sollten die ermittelten Kurse nicht belastbar sein, wird auf den mit geeigneten Bewertungsmodellen ermittelten Verkehrswert abgestellt (§ 28 KARBV).

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

Gesamtkostenquote *)	0,38 %
Transaktionskosten**)	EUR 146.948,24

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

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

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.

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen:

1) Im Wesentlichen Quellensteuererstattungen

2) Im Wesentlichen Depotgebühren, Kosten für die Marktrisikomessung und Gebühren für die BaFin

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.

Hamburg, 18. März 2016

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Geschäftsführung

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

Wiedergabe des Vermerks des Abschlussprüfers

An die HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft mbH, Hamburg

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft mbH hat uns beauftragt, gemäß § 102 des Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) den Jahresbericht des Sondervermögens Quant.Euro Long Variable für das Rumpfgeschäftsjahr vom 7. Mai 2015 bis 31. Dezember 2015 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 Sondervermögens 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 Rumpfgeschäftsjahr vom 7. Mai 2015 bis 31. Dezember 2015 den gesetzlichen Vorschriften.

Hamburg, den 21. März 2016

PricewaterhouseCoopers
Aktiengesellschaft
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Lothar Schreiber ppa. Christoph Wappler
Wirtschaftsprüfer Wirtschaftsprüfer

Besteuerung der Ausschüttung

HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

Geschäftsjahr vom 07.05.2015 bis 31.12.2015

Ex-Tag der Ausschüttung: 22.01.2016

Valuta: 22.01.2016

Datum des Ausschüttungsbeschlusses: 15.01.2016

Name des Investmentfonds: Quant.Euro Long Variable EB

ISIN: DE000A12BK3

§ 5 Abs. 1 S. 1 Nr. InvStG		Privatvermögen EUR je Anteil	Betriebsvermögen KStG ¹⁾ EUR je Anteil	Sonst. Betriebsvermögen ²⁾ EUR je Anteil
	Barausschüttung	0,5500000	0,5500000	0,5500000
1 a)	Betrag der Ausschüttung ³⁾	0,6652198	0,6652198	0,6652198
	aa) in der Ausschüttung enthaltene ausschüttungsgleiche Erträge der Vorjahre	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	bb) in der Ausschüttung enthaltene Substanzbeträge	0,0000000	0,0000000	0,0000000
2)	Teilthesaurierungsbetrag/ ausschüttungsgleicher Ertrag	0,2191875	0,2191875	0,2191875
1 b)	Betrag der ausgeschütteten Erträge	0,6652198	0,6652198	0,6652198
1 c)	Im Betrag der ausgeschütteten/ ausschüttungsgleichen Erträge 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⁾	-	-	0,8675558
	bb) Veräußerungsgewinne i.S.d. § 2 Abs. 2 S. 2 i.V.m. § 8b Abs. 2 KStG oder § 3 Nr. 40 EStG ⁴⁾	-	0,0000000	0,0000000
	cc) Erträge i.S.d. § 2 Abs. 2a (Zinsschranke)	-	0,0000000	0,0000000
	dd) steuerfreie Veräußerungsgewinne i.S.d. § 2 Abs. 3 Nr. 1 S. 1 in der am 31. Dezember 2008 anzuwendenden Fassung	0,0000000	-	-
	ee) Erträge i.S.d. § 2 Abs. 3 Nr. 1 S. 2 in der am 31. Dezember 2008 anzuwendenden Fassung, soweit die Erträge nicht Kapitalerträge i.S.d. § 20 EStG sind	0,0000000	-	-
	ff) steuerfreie Veräußerungsgewinne i.S.d. § 2 Abs. 3 in der ab 1. Januar 2009 anzuwendenden Fassung	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	0,3321499	0,3321499	0,3321499
	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	-	-	0,3321499
	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 berechtigen	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	0,7430083	0,7430083	0,7430083
	bb) i.S.d. § 7 Abs. 3	0,1413990	0,1413990	0,1413990
	davon inländische Mieterträge	0,0000000	0,0000000	0,0000000
	cc) i.S.d. § 7 Abs. 1 S. 4, soweit in 1 d aa) enthalten	0,7430083	0,7430083	0,7430083
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⁾	0,0469085	0,0469085	0,0469085
	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	-	-	0,0469085
	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⁾	0,1152198	0,1152198	0,1152198

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 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) Der Betrag der Ausschüttung ist ausgewiesen zuzüglich auf Ebene des Investmentfonds abzuführender Kapitalertragsteuer und Solidaritätszuschlag sowie gezahlter, abzüglich erstatteter ausländischer Quellensteuern, soweit § 4 Abs. 4 InvStG nicht angewendet wurde (BMF-Schreiben v. 18.08.2009, Tz. 12).
- 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 das vorstehende Investmentvermögen 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 den oben genannten Investmentfonds für den genannten Zeitraum zu veröffentlichenden Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG nach den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden.

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 Ermittlung beruht auf der Buchführung/den Aufzeichnungen und dem Jahresbericht nach § 44 Abs. 1 InvG bzw. § 101 Abs. 1 Kapitalanlagegesetzbuch (KAGB) für den betreffenden Zeitraum. Sie besteht aus einer Überleitungsrechnung aufgrund steuerlicher Vorschriften und der Zusammenstellung der zur Bekanntmachung bestimmten steuerlichen Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG. In den Jahresbericht sowie in die steuerlichen Angaben sind Werte aus einem Ertragsausgleich eingegangen. Soweit die Gesellschaft Mittel in Anteile an anderen Investmentfonds (Zielfonds) investiert hat, verwendet sie die ihr für diese Zielfonds vorliegenden steuerlichen Angaben.

Unsere Aufgabe ist es, auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfung eine Beurteilung abzugeben, ob die von der Gesellschaft nach den Vorschriften des

InvStG zu veröffentlichenden Angaben in Übereinstimmung mit den Regeln des deutschen Steuerrechts ermittelt wurden.

Unsere Prüfung erfolgt auf der Grundlage der von einem Abschlussprüfer nach § 44 Abs. 5 InvG bzw. § 102 KAGB geprüften Buchführung/Aufzeichnungen und des geprüften Jahresberichtes. Unserer Beurteilung unterliegen die darauf beruhende Überleitungsrechnung und die zur Bekanntmachung bestimmten Angaben. Unsere Prüfung erstreckt sich insbesondere auf die steuerliche Qualifikation von Kapitalanlagen, von Erträgen und Aufwendungen einschließlich deren Zuordnung als Werbungskosten sowie sonstiger steuerlicher Aufzeichnungen. Soweit die Gesellschaft Mittel in Anteile an Zielfonds investiert hat, beschränkte unsere Prüfung auf die korrekte Übernahme der für diese Zielfonds von anderen zur Verfügung gestellten steuerlichen Angaben durch die Gesellschaft nach Maßgabe vorliegender Bescheinigungen. Die entsprechenden steuerlichen Angaben wurden von uns nicht geprüft.

Wir haben unsere Prüfung unter entsprechender 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 werden die Wirk-

samkeit des auf die Ermittlung der Angaben nach § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG bezogenen internen Kontrollsystems sowie Nachweise für die steuerlichen Angaben überwiegend auf der Basis von Stichproben beurteilt.

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.

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.

Frankfurt am Main, den 23.03.2016

KPMG AG

Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Olaf J. Mielke, MBA Eugenie Jurk
Steuerberater Steuerberaterin

Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien

Kapitalverwaltungsgesellschaft:

HANSAINVEST
Hanseatische Investment-GmbH
Postfach 60 09 45
22209 Hamburg
Hausanschrift:
Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Kunden-Servicecenter:
Telefon: (040) 3 00 57 - 62 96
Telefax: (040) 3 00 57 - 61 42
Internet: www.hansainvest.de
E-Mail: service@hansainvest.de

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 10.500.000,-
Haftendes Eigenkapital:
€ 10.161.611,-
(Stand: 31.12.2014)

Gesellschafter:

SIGNAL IDUNA
Allgemeine Versicherung AG, Dortmund
IDUNA Vereinigte Lebensversicherung
aG für Handwerk, Handel und Gewerbe,
Hamburg

Verwahrstelle:

State Street Bank GmbH, München
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 109.267.000,-
Haftendes Eigenkapital:
€ 1.380.845.000,-
(Stand: 31.12.2014)

Einzahlungen:

UniCredit Bank AG, München
(vorm. Bayerische Hypo- und
Vereinsbank)
BIC: HYVEDEMM300
IBAN: DE15200300000000791178

Aufsichtsrat:

Martin Berger (Vorsitzender),
stv. Mitglied der Vorstände der
SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
(zugleich Vorsitzender des Aufsichts-
rates der SIGNAL IDUNA Asset
Management GmbH)

Dr. Karl-Josef Bierth
(stellvertretender Vorsitzender),
Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA
Gruppe, Hamburg

Thomas Gollub,
Vorstandsvorsitzender der Aramea Asset
Management AG, Hamburg (zugleich
stellvertretender Präsident des Verwal-
tungsrats der HANSAINVEST LUX S.A.)

Thomas Janta,
Direktor NRW.BANK, Düsseldorf

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

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

Wirtschaftsprüfer:

PricewaterhouseCoopers Aktiengesell-
schaft Wirtschaftsprüfungsgesellschaft,
Hamburg

Geschäftsführung:

Nicholas Brinckmann

Marc Drießen

Dr. Jörg W. Stotz
(zugleich Präsident des Verwaltungsrats
der HANSAINVEST LUX S.A. sowie
Mitglied der Geschäftsführung der
SIGNAL IDUNA Asset Management
GmbH)

HANSAINVEST
Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg
Telefon: (040) 3 00 57 - 62 96
Telefax: (040) 3 00 57 - 61 42

service@hansainvest.de
www.hansainvest.de