

Jahresbericht zum 31. Dezember 2016

Quant.Sigma Pro

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Quant.Sigma Pro

in der Zeit vom 01. Januar 2016 bis 31. Dezember 2016.

Hamburg, im April 2017

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 2016	4
Vermögensaufstellung per 31. Dezember 2016	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	18
Wiedergabe des Vermerks des Abschlussprüfers	20
Besteuerung der Wiederanlage	21
Bescheinigung nach § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 InvStG	22
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	24

Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr 2016

Anlageziel und Anlagepolitik

Ziel des Quant.Sigma Pro ist es, positive Erträge unabhängig von der allgemeinen Kapitalmarktentwicklung, bzw. bei fallenden wie steigenden Märkten zu erzielen („Absolute Return“).

Dieses Ziel soll durch Implementierung zweier sich ergänzender, nicht korrelierter Strategiekonzepte erreicht werden – durch ein algorithmisches Modell im Devisenkassamarkt und durch aktives Management von impliziter Volatilität im Devisenoptionsmarkt. Die Allokation orientiert sich an definierten Risikomanagement-Parametern und der Wahrung ausgewogener Chance-/Risiko-Verhältnisse.

Portfoliostruktur

Im Berichtszeitraum variierte die Verteilung der jeweiligen Anlageklassen über die gesamte Schwankungsbreite, hielt sich dabei jedoch innerhalb der im Investmentvermögen definierten maximalen Teilallokationen (Währungen, Derivate und Cash).

Veräußerungsergebnisse

Die in Euro erzielten Veräußerungsergebnisse betragen im Berichtszeitraum EUR 324.849,41.

Sie resultierten aus realisierten Erfolgen aus Währungstransaktionen.

Risikoanalyse

Die historische Volatilität des Fonds beträgt zum 30.12.2016 6,60 % p. a.

Adressenausfallrisiken:

Die Ausfallrisiken in Geldmarktpositionen sind durch die Verteilung auf sieben verschiedenen Kreditinstitute sowie die kurzen Restlaufzeiten (< 3 Monate) sowie die Einlagensicherungsinstitutionen stark begrenzt.

Marktpreisrisiken:

Das zentrale Marktpreisrisiko des Investmentvermögens liegt in der Wertentwicklung der jeweiligen Währungskurse und impliziten Volatilitäten.

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.

Sollten im Geldmarkt zukünftig für Einlagen nur negative Zinsen erzielbar sein, könnte dies die Performance des Fonds belasten.

Sonstige Hinweise

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

Das Portfoliomanagement für den Quant. Sigma Pro ist weiterhin an die Quant. Capital Management GmbH ausgelagert. Hierbei handelt es sich um ein nicht mit der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH verbundenes Unternehmen.

Wesentliche Ereignisse

Keine

Vermögensaufstellung per 31. Dezember 2016

Fondsvermögen: EUR 9.990.658,05 (9.951.051,12)

Umlaufende Anteile: Stück EB-Klasse 107.330 (107.330)

Vermögensübersicht zum 31.12.2016			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens VJ
I. Vermögensgegenstände			
1. Anleihen	40.386,35	0,40	(0,40)
2. Derivate	549.027,78	5,50	(7,11)
3. Bankguthaben	9.437.896,91	94,47	(92,73)
4. Sonstige Vermögensgegenstände	3.817,25	0,04	(0,00)
II. Verbindlichkeiten	-40.470,24	-0,41	(-0,24)
III. Fondsvermögen	9.990.658,05	100,00	

(Angaben in Klammern per 31.12.2015)

Vermögensaufstellung zum 31.12.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens	
					im Berichtszeitraum					
Börsengehandelte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
0,000000000% Niederlande EO-Anl. 15/18	NL0011005137		EUR	40	0	0	% 100,965875	40.386,35	0,40	
Summe der börsengehandelten Wertpapiere								EUR	40.386,35	0,40
Summe Wertpapiervermögen								EUR	40.386,35	0,40
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
Devisen-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten										
Devisenterminkontrakte (Verkauf)										
Offene Positionen										
NZD/USD 0,40 Mio.		OTC						9.412,21	0,09	
NOK/SEK 2,50 Mio.		OTC						-12.269,05	-0,12	
NOK/SEK 3,00 Mio.		OTC						-15.154,28	-0,15	
EUR/NZD 1,75 Mio.		OTC						45.315,47	0,45	
NZD/USD 0,20 Mio.		OTC						9.317,05	0,09	
NZD/USD 0,30 Mio.		OTC						6.225,85	0,06	
USD/JPY 0,71 Mio.		OTC						-74.740,23	-0,75	
EUR/SEK 0,20 Mio.		OTC						8.913,63	0,09	
EUR/GBP 0,30 Mio.		OTC						8.734,52	0,09	
EUR/GBP 0,30 Mio.		OTC						13.458,48	0,13	
EUR/GBP 0,30 Mio.		OTC						5.239,08	0,05	
USD/JPY 0,40 Mio.		OTC						-38.394,34	-0,38	
NZD/USD 0,30 Mio.		OTC						11.846,84	0,12	
NZD/USD 1,20 Mio.		OTC						19.106,52	0,19	
USD/JPY 0,81 Mio.		OTC						-77.682,20	-0,78	
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						-46.557,27	-0,47	
USD/JPY 0,40 Mio.		OTC						-38.397,29	-0,38	
NZD/USD 0,30 Mio.		OTC						11.394,90	0,11	
AUD/USD 1,90 Mio.		OTC						74.852,64	0,75	
NOK/SEK 2,00 Mio.		OTC						-6.324,12	-0,06	
NOK/SEK 2,50 Mio.		OTC						-11.919,46	-0,12	
NZD/USD 0,30 Mio.		OTC						7.826,25	0,08	
NOK/SEK 3,00 Mio.		OTC						-9.969,06	-0,10	
NZD/USD 0,25 Mio.		OTC						3.113,45	0,03	
NZD/USD 0,25 Mio.		OTC						1.611,26	0,02	
NOK/SEK 1,50 Mio.		OTC						-1.633,24	-0,02	
NOK/SEK 3,00 Mio.		OTC						-3.964,29	-0,04	
EUR/GBP 1,25 Mio.		OTC						5.309,03	0,05	
EUR/GBP 0,20 Mio.		OTC						853,87	0,01	
EUR/GBP 0,30 Mio.		OTC						1.024,55	0,01	
EUR/JPY 3,00 Mio.		OTC						-21.253,00	-0,21	
USD/CHF 1,99 Mio.		OTC						-72.359,64	-0,72	
USD/CHF 0,20 Mio.		OTC						-4.938,97	-0,05	
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-19.241,05	-0,19	
USD/CHF 0,30 Mio.		OTC						-9.411,28	-0,09	
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-16.154,23	-0,16	

Vermögensaufstellung zum 31.12.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
USD/JPY 0,15 Mio.		OTC						-10.068,57	-0,10
USD/JPY 0,20 Mio.		OTC						-7.854,96	-0,08
USD/CHF 0,20 Mio.		OTC						-1.679,25	-0,02
USD/CHF 0,15 Mio.		OTC						-1.930,19	-0,02
NZD/USD 0,25 Mio.		OTC						6.140,72	0,06
EUR/USD 0,70 Mio.		OTC						17.402,34	0,17
NZD/USD 0,25 Mio.		OTC						4.969,38	0,05
USD/CHF 1,98 Mio.		OTC						-25.133,66	-0,25
NZD/USD 0,30 Mio.		OTC						4.009,03	0,04
AUD/USD 1,90 Mio.		OTC						23.374,10	0,23
NZD/USD 0,20 Mio.		OTC						2.743,63	0,03
USD/CAD 0,25 Mio.		OTC						771,76	0,01
EUR/JPY 0,50 Mio.		OTC						-10.810,15	-0,11
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-10.962,19	-0,11
USD/JPY 0,30 Mio.		OTC						-13.717,25	-0,14
USD/JPY 0,15 Mio.		OTC						-3.998,06	-0,04
USD/JPY 0,20 Mio.		OTC						-9.110,60	-0,09
EUR/USD 0,20 Mio.		OTC						-466,07	0,00
USD/JPY 0,02 Mio.		OTC						153,46	0,00
USD/CAD 0,15 Mio.		OTC						603,61	0,01
USD/CHF 0,80 Mio.		OTC						5.059,41	0,05
EUR/USD 0,30 Mio.		OTC						-1.462,91	-0,01
USD/CHF 0,15 Mio.		OTC						932,05	0,01
EUR/NZD 0,15 Mio.		OTC						-1.483,24	-0,01
USD/CAD 0,15 Mio.		OTC						-1.060,54	-0,01
USD/JPY 0,20 Mio.		OTC						-19.354,90	-0,19
USD/JPY 0,40 Mio.		OTC						-39.104,22	-0,39
USD/JPY 0,40 Mio.		OTC						-39.000,37	-0,39
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						-50.288,49	-0,50
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						-50.129,20	-0,50
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						-46.252,21	-0,46
USD/CAD 0,20 Mio.		OTC						249,28	0,00
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-20.942,33	-0,21
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-20.392,39	-0,20
USD/CAD 0,40 Mio.		OTC						109,51	0,00
USD/CHF 1,40 Mio.		OTC						-31.899,78	-0,32
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-14.155,34	-0,14
EUR/SEK 0,30 Mio.		OTC						15.236,01	0,15
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-26.825,38	-0,27
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-28.379,16	-0,28
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-23.401,28	-0,23
USD/CAD 0,20 Mio.		OTC						325,81	0,00
USD/CHF 0,20 Mio.		OTC						-3.556,59	-0,04
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-15.266,26	-0,15
EUR/SEK 0,25 Mio.		OTC						6.011,51	0,06

Vermögensaufstellung zum 31.12.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
USD/CAD 0,30 Mio.		OTC						-4.210,54	-0,04
USD/JPY 0,70 Mio.		OTC						91.194,41	0,91
EUR/JPY 1,00 Mio.		OTC						12.314,43	0,12
USD/CAD 0,15 Mio.		OTC						-1.514,95	-0,02
USD/CHF 0,30 Mio.		OTC						66,19	0,00
USD/CHF 0,25 Mio.		OTC						1.530,14	0,02
NOK/SEK 4,00 Mio.		OTC						-44.526,83	-0,45
Geschlossene Positionen									
NZD/USD 0,27 Mio.		OTC						5.789,99	0,06
USD/JPY 1,00 Mio.		OTC						-114.827,69	-1,15
NZD/USD 0,20 Mio.		OTC						6.246,34	0,06
USD/JPY 0,25 Mio.		OTC						-4.021,95	-0,04
USD/JPY 4,00 Mio.		OTC						16.123,92	0,16
EUR/NZD 0,50 Mio.		OTC						9.412,28	0,09
USD/CHF 0,80 Mio.		OTC						-18.724,75	-0,19
USD/SEK 0,25 Mio.		OTC						-263,71	0,00
USD/SEK 0,25 Mio.		OTC						1.373,93	0,01
USD/JPY 0,49 Mio.		OTC						-45.898,34	-0,46
EUR/SEK 0,30 Mio.		OTC						-4.462,49	-0,04
EUR/SEK 0,20 Mio.		OTC						5.294,88	0,05
USD/SEK 0,50 Mio.		OTC						-3.338,17	-0,03
USD/CHF 0,25 Mio.		OTC						-4.734,59	-0,05
USD/CAD 0,75 Mio.		OTC						2.378,89	0,02
USD/CAD 0,40 Mio.		OTC						4.765,03	0,05
AUD/USD 3,30 Mio.		OTC						35.860,21	0,36
NZD/USD 6,13 Mio.		OTC						-64.255,31	-0,64
EUR/GBP 1,75 Mio.		OTC						-5.488,30	-0,05
USD/JPY 3,20 Mio.		OTC						-247.325,25	-2,48
USD/CHF 1,20 Mio.		OTC						-26.781,87	-0,27
EUR/USD 3,29 Mio.		OTC						117.391,31	1,18
AUD/USD 1,70 Mio.		OTC						36.052,71	0,36
USD/JPY 1,00 Mio.		OTC						-8.595,66	-0,09
AUD/USD 1,70 Mio.		OTC						18.108,62	0,18
GBP/USD 0,50 Mio.		OTC						94,67	0,00
USD/CHF 0,20 Mio.		OTC						-9.346,40	-0,09
EUR/SEK 0,20 Mio.		OTC						-1.373,59	-0,01
USD/SEK 0,25 Mio.		OTC						-2.277,55	-0,02
EUR/SEK 0,20 Mio.		OTC						4.409,04	0,04
USD/SEK 0,20 Mio.		OTC						2.056,69	0,02
USD/SEK 0,25 Mio.		OTC						-2.890,59	-0,03
USD/CHF 1,95 Mio.		OTC						13.946,98	0,14
EUR/SEK 0,40 Mio.		OTC						4.805,70	0,05
USD/CHF 0,20 Mio.		OTC						-7.669,72	-0,08
USD/CHF 0,20 Mio.		OTC						-7.367,48	-0,07
USD/CHF 0,20 Mio.		OTC						-6.455,95	-0,06

Vermögensaufstellung zum 31.12.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
USD/CHF 0,20 Mio.		OTC						-5.717,74	-0,06
USD/CHF 0,20 Mio.		OTC						-4.495,43	-0,04
USD/CAD 0,30 Mio.		OTC						5.803,13	0,06
USD/SEK 0,10 Mio.		OTC						1.588,01	0,02
USD/SEK 0,52 Mio.		OTC						-454,93	0,00
USD/JPY 2,00 Mio.		OTC						-48.857,93	-0,49
USD/JPY 3,30 Mio.		OTC						170.350,02	1,71
NOK/SEK 2,50 Mio.		OTC						-31.815,44	-0,32
AUD/USD 1,40 Mio.		OTC						17.761,95	0,18
EUR/USD 1,40 Mio.		OTC						-8.635,40	-0,09
EUR/USD 1,60 Mio.		OTC						43.000,00	0,43
Devisenterminkontrakte (Kauf)									
Offene Positionen									
EUR/USD 0,30 Mio.		OTC						-20.255,11	-0,20
EUR/USD 0,30 Mio.		OTC						-14.572,43	-0,15
EUR/CAD 1,30 Mio.		OTC						-55.580,91	-0,56
USD/JPY 0,15 Mio.		OTC						16.683,36	0,17
EUR/CAD 1,95 Mio.		OTC						-99.627,44	-1,00
USD/JPY 0,70 Mio.		OTC						-7.570,06	-0,08
EUR/CAD 0,15 Mio.		OTC						62,65	0,00
EUR/CAD 0,20 Mio.		OTC						-5.785,15	-0,06
EUR/CAD 0,15 Mio.		OTC						-3.679,95	-0,04
EUR/CAD 0,15 Mio.		OTC						779,66	0,01
EUR/CAD 0,15 Mio.		OTC						2.718,77	0,03
AUD/USD 0,25 Mio.		OTC						-2.092,85	-0,02
AUD/USD 0,25 Mio.		OTC						210,74	0,00
EUR/CAD 0,15 Mio.		OTC						559,49	0,01
AUD/USD 0,25 Mio.		OTC						-1.214,08	-0,01
AUD/USD 0,30 Mio.		OTC						-514,86	-0,01
EUR/USD 3,63 Mio.		OTC						90,05	0,00
AUD/USD 0,25 Mio.		OTC						537,95	0,01
AUD/USD 0,30 Mio.		OTC						1.318,10	0,01
AUD/USD 0,25 Mio.		OTC						-2.729,05	-0,03
AUD/USD 0,25 Mio.		OTC						-1.575,59	-0,02
AUD/USD 0,25 Mio.		OTC						-2.983,15	-0,03
AUD/USD 2,78 Mio.		OTC						-66.624,08	-0,67
EUR/CAD 0,15 Mio.		OTC						-1.452,99	-0,01
EUR/CAD 0,10 Mio.		OTC						-773,70	-0,01
EUR/CAD 0,15 Mio.		OTC						-2.127,39	-0,02
AUD/USD 0,40 Mio.		OTC						-7.824,66	-0,08
AUD/USD 0,30 Mio.		OTC						-4.446,37	-0,04
EUR/SEK 0,25 Mio.		OTC						-3.145,83	-0,03
Geschlossene Positionen									
USD/JPY 1,70 Mio.		OTC						176.824,24	1,77
USD/JPY 1,30 Mio.		OTC						156.962,09	1,57
AUD/USD 2,80 Mio.		OTC						-1.420,94	-0,01

Vermögensaufstellung zum 31.12.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
USD/CAD 3,00 Mio.		OTC						55.506,80	0,56
USD/CAD 0,25 Mio.		OTC						4.482,62	0,04
AUD/USD 0,19 Mio.		OTC						-1.168,34	-0,01
USD/CAD 0,25 Mio.		OTC						6.607,45	0,07
USD/JPY 0,52 Mio.		OTC						-10.808,80	-0,11
EUR/USD 0,40 Mio.		OTC						6.952,28	0,07
USD/CAD 0,25 Mio.		OTC						5.855,51	0,06
USD/CAD 0,25 Mio.		OTC						9.052,15	0,09
USD/CAD 0,25 Mio.		OTC						10.357,96	0,10
USD/CAD 0,25 Mio.		OTC						9.510,32	0,10
USD/CAD 0,25 Mio.		OTC						8.037,14	0,08
USD/JPY 4,10 Mio.		OTC						295.807,57	2,96
EUR/CAD 1,45 Mio.		OTC						502,35	0,01
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						26.584,63	0,27
AUD/USD 3,10 Mio.		OTC						-65.612,46	-0,66
EUR/USD 0,95 Mio.		OTC						-23.689,38	-0,24
USD/JPY 0,50 Mio.		OTC						-42,44	0,00
EUR/USD 1,07 Mio.		OTC						-53.299,59	-0,53
EUR/USD 0,67 Mio.		OTC						-33.710,26	-0,34
USD/SEK 0,30 Mio.		OTC						10.351,22	0,10
AUD/USD 1,20 Mio.		OTC						-25.233,27	-0,25
AUD/USD 1,01 Mio.		OTC						-22.673,47	-0,23
EUR/USD 0,60 Mio.		OTC						-6.409,71	-0,06
USD/JPY 0,46 Mio.		OTC						-30.486,23	-0,31
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Devisen									
Put Devisenopt.USD/JPY Put 05.01.2017 113,25 113,250000000 05.01.2017	DE000FXD0599		STK	-1				-5.645,02	-0,06
Call Devisenopt.USD/CHF Call 30.11.2017 0,98 0,980000000 30.11.2017	DE000FXD0342		STK	1				48.340,34	0,48
Put Devisenopt.EUR/USD Put 23.05.2017 1,05 1,050000000 23.05.2017	DE000FXD2314		STK	5.000				124.593,62	1,25
Put Devisenopt.EUR/USD Put 23.05.2017 1,00 1,000000000 23.05.2017	DE000FXD2322		STK	-5.000				-54.177,45	-0,54
Put Devisenopt.EUR/JPY Put 24.02.2017 115 115,000000000 24.02.2017	DE000FXD2348		STK	2.500				8.051,24	0,08
Call Devisenopt.EUR/JPY Call 24.02.2017 122 122,000000000 24.02.2017	DE000FXD2330		STK	2.500				46.167,20	0,46
Call Devisenopt.AUD/USD Call 17.02.2017 0,7725 0,772500000 17.02.2017	DE000FXD2272		STK	-7.500				-3.050,16	-0,03
Put Devisenopt.EUR/USD Put 23.02.2017 1,0375 1,037500000 23.02.2017	DE000FXD2298		STK	5.000				52.906,51	0,53
Put Devisenopt USD/JPY Put 25.01.2017 113,5 113,500000000 25.01.2017	DE000FXD2587		STK	-4.000				-22.359,43	-0,22
Call Devisenopt USD/JPY Call 09.01.2017 118,5 118,500000000 09.01.2017	DE000FXD2553		STK	2.000				4.769,39	0,05
Put Devisenopt USD/JPY Put 25.01.2017 116,5 116,500000000 25.01.2017	DE000FXD2579		STK	3.000				43.279,28	0,43
Put Devisenopt.EUR/USD Put 05.06.2017 1,061 1,061000000 05.06.2017	DE000FXD2462		STK	-5.000				-153.342,11	-1,53
Put Devisenopt.EUR/JPY Put 01.06.2017 116 116,000000000 01.06.2017	DE000FXD2454		STK	-5.000				-87.511,27	-0,88

Vermögensaufstellung zum 31.12.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Call Devisenopt.USD/CHF Call 18.04.2017 1,018 1,018000000 18.04.2017	DE000FXD2413		STK	5.000				100.237,10	1,00
Put Devisenopt.AUD/USD Put 30.03.2017 0,72 0,720000000 30.03.2017	DE000FXD2421		STK	10.000				160.184,32	1,60
Put Devisenopt.AUD/USD Put 01.09.2017 0,73 0,730000000 01.09.2017	DE000FXD2439		STK	-4.000				-132.079,20	-1,32
Call Devisenopt.EUR/JPY Call 01.06.2017 126,75 126,750000000 01.06.2017	DE000FXD2447		STK	5.000				87.594,69	0,88
Call Devisenopt.GBP/USD Call 17.02.2017 1,32 1,320000000 17.02.2017	DE000FXD2546		STK	-5.000				-2.011,22	-0,02
Put Devisenopt USD/JPY Put 09.01.2017 115,25 115,250000000 09.01.2017	DE000FXD2561		STK	-2.000				-9.595,10	-0,10
Put Devisenopt USD/JPY Put 14.09.2017 94,7 94,700000000 14.09.2017	DE000FXD2371		STK	10.000				33.797,00	0,34
Call Devisenopt USD/JPY Call 14.09.2017 118,4 118,400000000 14.09.2017	DE000FXD2405		STK	-5.000				-134.765,57	-1,35
Call Devisenopt.AUD/USD Call 16.03.2017 0,743 0,743000000 16.03.2017	DE000FXD2512		STK	5.000				28.516,09	0,29
Put Devisenopt.USD/JPY Put 13.07.2017 107 107,000000000 13.07.2017	DE000FXD2496		STK	-5.000				-62.726,49	-0,63
Put Devisenopt.AUD/USD Put 16.03.2017 0,7 0,700000000 16.03.2017	DE000FXD2520		STK	-7.000				-52.637,25	-0,53
Call Devisenopt.GBP/USD Call 17.02.2017 1,27 1,270000000 17.02.2017	DE000FXD2538		STK	2.500				9.530,14	0,10
Put Devisenopt.USD/CHF Put 17.08.2017 0,975 0,975000000 17.08.2017	DE000FXD2256		STK	-3.000				-53.896,66	-0,54
Put Devisenopt.USD/CAD Put 13.02.2017 1,35 1,350000000 13.02.2017	DE000FXD2231		STK	-2.000				-24.106,20	-0,24
Call Devisenopt.EUR/USD Call 05.06.2017 1,103 1,103000000 05.06.2017	DE000FXD2470		STK	5.000				56.185,96	0,56
Put Devisenopt.USD/CHF Put 16.03.2017 0,99 0,990000000 16.03.2017	DE000FXD2504		STK	-3.000				-20.677,60	-0,21
Put Devisenopt.USD/CHF Put 18.04.2017 0,995 0,995000000 18.04.2017	DE000FXD2215		STK	-7.000				-31.116,72	-0,31
Call Devisenopt.USD/CAD Call 13.02.2017 1,35 1,350000000 13.02.2017	DE000FXD2223		STK	-2.000				-23.566,93	-0,24
Put Devisenopt.AUD/USD Put 17.02.2017 0,717 0,717000000 17.02.2017	DE000FXD2264		STK	7.500				73.132,15	0,73
Call Devisenopt.USD/CHF Call 18.04.2017 1,065 1,065000000 18.04.2017	DE000FXD2199		STK	7.000				44.124,78	0,44
Put Devisenopt USD/JPY Put 14.09.2017 105,5 105,500000000 14.09.2017	DE000FXD2397		STK	-5.000				-70.324,52	-0,70
Call Devisenopt USD/JPY Call 14.09.2017 130,1 130,100000000 14.09.2017	DE000FXD2389		STK	10.000				69.498,64	0,70
Put Devisenopt.NZD/USD Put 27.04.2017 0,635 0,635000000 27.04.2017	DE000FXD2116		STK	12.500				53.534,09	0,54
Call Devisenopt.EUR/USD Call 28.07.2017 1,20 1,200000000 28.07.2017	DE000FXD2207		STK	-5.000				-10.934,77	-0,11
Put Devisenopt.AUD/USD Put 17.02.2017 0,68 0,680000000 17.02.2017	DE000FXD1704		STK	8.000				14.045,83	0,14
Put Devisenopt.USD/CAD Put 15.02.2017 1,25 1,250000000 15.02.2017	DE000FXD1662		STK	8.000				714,92	0,01
Call Devisenopt.USD/CAD Call 15.02.2017 1,43 1,430000000 15.02.2017	DE000FXD1670		STK	8.000				7.590,76	0,08
Call Devisenopt.AUD/USD Call 06.03.2017 0,80 0,800000000 06.03.2017	DE000FXD1779		STK	7.500				1.000,94	0,01
Put Devisenopt.EUR/USD Put 28.07.2017 1,132 1,132000000 28.07.2017	DE000FXD1621		STK	3.000				231.949,69	2,32
Call Devisenopt.EUR/USD Call 28.07.2017 1,132 1,132000000 28.07.2017	DE000FXD1613		STK	-3.000				-27.243,91	-0,27
Call Devisenopt USD/JPY Put 14.09.2017 112,5 112,500000000 14.09.2017	DE000FXD1910		STK	-1.750				-87.802,52	-0,88

Vermögensaufstellung zum 31.12.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Call Devisenopt.EUR/GBP Call 21.02.2017 0,875 0,875000000 21.02.2017	DE000FXD1951		STK	6.000				45.632,96	0,46
Call Devisenopt.EUR/NZD Call 13.03.2017 1,6435 1,643500000 13.03.2017	DE000FXD1878		STK	5.000				10.195,08	0,10
Put Devisenopt.EUR/NZD Put 13.03.2017 1,4815 1,481500000 13.03.2017	DE000FXD1886		STK	-5.000				-45.268,02	-0,45
Put Devisenopt.USD/SEK Put 21.03.2017 8,1362 8,136200000 21.03.2017	DE000FXD1944		STK	5.000				1.672,91	0,02
Put Devisenopt.EUR/GBP Put 21.02.2017 0,82 0,820000000 21.02.2017	DE000FXD1969		STK	-4.000				-9.797,25	-0,10
Put Devisenopt.AUD/JPY Put 24.01.2017 79 79,000000000 24.01.2017	DE000FXD2090		STK	2.500				2.926,79	0,03
Put Devisenopt.NZD/USD Put 27.04.2017 0,69 0,690000000 27.04.2017	DE000FXD2124		STK	-7.500				-135.426,94	-1,36
Call Devisenopt.USD/CAD Call 13.03.2017 1,3064 1,306400000 13.03.2017	DE000FXD1852		STK	2.500				87.833,13	0,88
Put Devisenopt.USD/CAD Put 13.03.2017 1,3064 1,306400000 13.03.2017	DE000FXD1860		STK	2.500				10.828,36	0,11
Put Devisenopt.EUR/SEK Put 27.03.2017 9,6 9,600000000 27.03.2017	DE000FXD2017		STK	3.000				48.328,92	0,48
Call Devisenopt.EUR/SEK Call 27.03.2017 9,6 9,600000000 27.03.2017	DE000FXD2009		STK	3.000				35.280,83	0,35
Put Devisenopt.NOK/SEK Put 22.02.2017 1,0108 1,010800000 22.02.2017	DE000FXD2082		STK	30.000				3.769,24	0,04
Put Devisenopt.AUD/JPY Put 24.01.2017 75 75,000000000 24.01.2017	DE000FXD2108		STK	-3.000				-297,96	0,00
Call Devisenopt.USD/JPY Call 13.07.2017 107 107,000000000 13.07.2017	DE000FXD1555		STK	5.000				403.052,42	4,03
Call Devisenopt.USD/JPY Call 13.07.2017 120 120,000000000 13.07.2017	DE000FXD1563		STK	-5.000				-97.157,98	-0,97
Put Devisenopt.EUR/CAD Put 26.01.2017 1,47 1,470000000 26.01.2017	DE000FXD1985		STK	5.000				208.958,49	2,09
Call Devisenopt.EUR/CAD Call 26.01.2017 1,54 1,540000000 26.01.2017	DE000FXD1993		STK	-5.000				-93,09	0,00
Call Devisenopt.GBP/USD Call 13.01.2017 1,65 1,650000000 13.01.2017	DE000FXD0664		STK	-1				0,00	0,00
Call Devisenopt.AUD/USD Call 16.03.2017 0,787 0,787000000 16.03.2017	DE000FXD0987		STK	1				2.762,06	0,03
Call Devisenopt.NZD/USD Call 15.03.2017 0,7185 0,718500000 15.03.2017	DE000FXD1316		STK	10.000				56.430,69	0,56
Call Devisenopt.USD/JPY Call 05.01.2017 113,25 113,250000000 05.01.2017	DE000FXD1365		STK	5.000				115.573,70	1,16
Put Devisenopt.AUD/USD Put 08.06.2017 0,7595 0,759500000 08.06.2017	DE000FXD1845		STK	-2.500				-114.720,09	-1,15
Call Devisenopt.AUD/USD Call 08.06.2017 0,7595 0,759500000 08.06.2017	DE000FXD1837		STK	-2.500				-17.754,38	-0,18
Call Devisenopt.NOK/SEK Call 10.01.2017 0,968 0,968000000 10.01.2017	DE000FXD0631		STK	1				264.942,98	2,65
Call Devisenopt.NOK/SEK Call 10.01.2017 1,0965 1,096500000 10.01.2017	DE000FXD0649		STK	-0				-33,81	0,00
Summe der Devisen-Derivate							EUR	549.027,77	5,50

Vermögensaufstellung zum 31.12.2016

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2016	Käufe/ Zugänge		Ver- käufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum						
Bankguthaben											
EUR - Guthaben bei:											
Verwahrstelle: State Street Bank International GmbH			EUR	1.797.919,34						1.797.919,34	18,00
Bank: BHF-Bank AG			EUR	1.300.000,00						1.300.000,00	13,01
Bank: Donner & Reuschel AG			EUR	1.145.636,97						1.145.636,97	11,47
Bank: National-Bank AG			EUR	1.496.163,54						1.496.163,54	14,98
Bank: Norddeutsche Landesbank -GZ-			EUR	1.797.141,82						1.797.141,82	17,99
Bank: UBS AG			EUR	1.400.025,00						1.400.025,00	14,01
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	498.881,93						498.881,93	4,99
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen:											
			GBP	0,43						0,50	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:											
			NZD	6.761,00						4.479,56	0,04
			CAD	3,16						2,23	0,00
Summe der Bankguthaben								EUR		9.440.250,89	94,49
Sonstige Vermögensgegenstände											
Sonstige Ansprüche			EUR	3.817,25						3.817,25	0,04
Summe sonstige Vermögensgegenstände										3.817,25	0,04
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme											
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen			USD	-2.468,85						-2.353,98	-0,02
Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme								EUR		-2.353,98	-0,02
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-40.470,24				EUR		-40.470,24	-0,41
Fondsvermögen								EUR		9.990.658,05	100*)
Anteilwert - Quant.Sigma Pro EB								EUR		93,08	
Umlaufende Anteile								STK		107.330	

Fußnoten:

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

1) noch nicht abgeführte Give-Up Gebühren, Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, 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.

Devisenkurse (in Mengennotiz)			per 30.12.2016
Australischer Dollar	AUD	1,454150	= 1 Euro (EUR)
Australischer Dollar	AUD	1,388732	= 1 US-Dollar (USD)
Kanadischer Dollar	CAD	1,414150	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	1,073650	= 1 Euro (EUR)
Euro	EUR	0,658754	= 1 Neuseeland-Dollar (NZD)
Euro	EUR	0,950069	= 1 US-Dollar (USD)
Euro	EUR	0,104619	= 1 Schwedische Krone (SEK)
Euro	EUR	1,164203	= 1 Britisches Pfund (GBP)
Euro	EUR	0,705841	= 1 Kanadischer Dollar (CAD)
Euro	EUR	0,008189	= 1 Japanischer Yen (JPY)
Britisches Pfund	GBP	0,857800	= 1 Euro (EUR)
Japanischer Yen	JPY	122,105000	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	NOK	9,079250	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	NOK	0,950268	= 1 Schwedische Krone (SEK)
Neuseeland-Dollar	NZD	1,509300	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland-Dollar	NZD	1,442372	= 1 US-Dollar (USD)
Schwedische Krone	SEK	9,561400	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,048800	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	0,008594	= 1 Japanischer Yen (JPY)
US-Dollar	USD	0,983475	= 1 Schweizer Franken (CHF)
US-Dollar	USD	0,742079	= 1 Kanadischer Dollar (CAD)
Marktschlüssel			
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 (Marktzugang zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Devisenterminkontrakte (Verkauf)					
Verkauf von Devisen auf Termin:					
EUR		USD			57.883,40
EUR		CAD			4.000,00
USD		GBP			1.546,20
AUD		NZD			2.103,65
USD		JPY			39.008,16
EUR		NOK			3.850,00
USD		AUD			2.867,27
NZD		AUD			632,92
EUR		CHF			2.350,00
EUR		GBP			20.100,00
GBP		USD			48.752,33
USD		CAD			26.616,19
JPY		EUR			7.800,00
GBP		EUR			4.650,00
USD		CHF			13.768,55
USD		EUR			4.500,00
JPY		USD			11.115,60
CAD		USD			3.157,34
NZD		USD			1.147,54
AUD		USD			62.715,78
AUD		CAD			4.622,64
CAD		CHF			301,91
USD		SEK			5.203,08
EUR		JPY			22.786,25
Devisenterminkontrakte (Kauf)					
Kauf von Devisen auf Termin:					
EUR		USD			52.806,00
AUD		NZD			204,87
USD		JPY			17.214,15
EUR		NOK			10.294,00
NZD		AUD			6,80
EUR		CHF			2.500,00
EUR		GBP			2.000,00
GBP		USD			3.990,75
USD		CAD			23.175,05
GBP		EUR			49,23
USD		EUR			280,45
JPY		USD			1.154,18
EUR		AUD			7.600,00
NZD		USD			1.802,52
AUD		USD			8.779,24
USD		SEK			347,46
EUR		JPY			2.363,75

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)

für den Zeitraum vom 01. Januar 2016 bis 31. Dezember 2016		Quant.Sigma Pro EB
I. Erträge		
1. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	-15.391,47*)
Summe der Erträge	EUR	-15.391,47
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR	-3.664,99
2. Verwaltungsvergütung	EUR	-66.201,38
3. Verwahrstellenvergütung	EUR	-26.568,19
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR	-8.865,79
5. Sonstige Aufwendungen 1)	EUR	-7.400,88
Summe der Aufwendungen	EUR	-112.701,23
III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	-128.092,70
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	EUR	8.663.627,92
2. Realisierte Verluste	EUR	-8.338.778,51
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	324.849,41
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	196.756,71
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	2.890.724,49
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-3.047.874,27
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-157.149,78
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	39.606,93

*) Der Sollsaldo resultiert aus negativen Habenzinsen

Entwicklung des Sondervermögens 2016

	Quant.Sigma Pro EB	
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR	9.951.051,12
1. Mittelzufluss / -abfluss (netto)	EUR	0,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen:	EUR	0,00
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen:	EUR	0,00
2. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	39.606,93
davon nicht realisierte Gewinne:	EUR	2.890.724,49
davon nicht realisierte Verluste:	EUR	-3.047.874,27
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR	9.990.658,05

Verwendung der Erträge des Sondervermögens

Berechnung der Wiederanlage	insgesamt		je Anteil *) **)
Quant.Sigma Pro EB			
I. Für die Wiederanlage verfügbar			
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	196.756,71	1,83
2. Zuführung aus dem Sondervermögen ***)	EUR	8.338.778,51	77,69
3. Zur Verfügung gestellter Steuerabzugsbetrag	EUR	0,00	0,00
II. Wiederanlage	EUR	8.535.535,22	79,53

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

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

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

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

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Quant.Sigma Pro EB	Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres		Anteilwert	
Geschäftsjahr				
2013	EUR	10.423,93	EUR	94,76
2014	EUR	10.261,93	EUR	93,29
2015	EUR	9.951.051,12	EUR	92,71
2016	EUR	9.990.658,05	EUR	93,08

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 41.642.710,03

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

UBS AG
UBS Europe SE

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	0,40
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	5,50

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

Angabe nach dem qualifizierten Ansatz:

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

kleinster potentieller Risikobetrag	0,91 %
größter potentieller Risikobetrag	4,30 %
durchschnittlicher potentieller Risikobetrag	2,52 %

Risikomodell, das gemäß § 10 DerivateV verwendet wurde:

Varianz-Kovarianz-Analyse mit Monte-Carlo-Add-on

Parameter, die gemäß § 11 DerivateV verwendet wurden:

99% Konfidenzniveau, 10 Tage Haltedauer bei einem effektiven historischen Beobachtungszeitraum von einem Jahr

Im Geschäftsjahr erreichte durchschnittliche Umfang des Leverage durch Derivategeschäfte

Mittelwert	9,16
------------	------

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens § 37 Abs. 5 DerivateV

Absolutes Marktrisikolimit	100,00 %
-----------------------------------	-----------------

Sonstige Angaben

Anteilwert - Quant.Sigma Pro EB	EUR	93,08
Umlaufende Anteile	STK	107.330

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 *)	1,16 %
Transaktionskosten**)	EUR 0,00
Erfolgsabhängige Vergütung in % des durchschnittlichen Nettoinventarwertes	0,00 %

*) 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 Kosten für die Marktrisikomessung, Depotgebühren

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, 31. März 2017

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 Quant.Sigma Pro für das Geschäftsjahr vom 1. Januar bis 31. Dezember 2016 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. Januar bis 31. Dezember 2016 den gesetzlichen Vorschriften.

Hamburg, den 3. April 2017

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Lothar Schreiber ppa. Christoph Wappler
Wirtschaftsprüfer Wirtschaftsprüfer

Besteuerung der Wiederanlage

HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH

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

Geschäftsjahr vom 01.01.2016 bis 31.12.2016

Steuerlicher Zufluss: 31.12.2016

Name des Investmentfonds: Quant.Sigma Pro EB

ISIN: DE000A1J67N1

§ 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 den 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 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 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 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 Überleitung 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 § 5 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 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 Überleitung 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 sich 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 sinnvoller 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 Prüfungshandlungen 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 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 S. 1 Nr. 1 und 2 InvStG beziehen, haben wir besondere Ermittlungen nur im Hinblick auf Vorgänge des laufenden Jahres vorgenom-

men. 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 dem 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 19.04.2017

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: (0 40) 3 00 57 - 62 96
Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70
Internet: www.hansainvest.de
E-Mail: service@hansainvest.de

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 10.500.000,-
Haftendes Eigenkapital:
€ 9.970.142,52
(Stand: 31.12.2015)

Gesellschafter:

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

Verwahrstelle:

State Street Bank International GmbH,
Frankfurt
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 109.267.000,-
Haftendes Eigenkapital:
€ 2.154.166.000,-
(Stand: 30.06.2016)

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, Hamburg

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 GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft,
Hamburg

Geschäftsführung:

Nicholas Brinckmann
(zugleich Mitglied 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