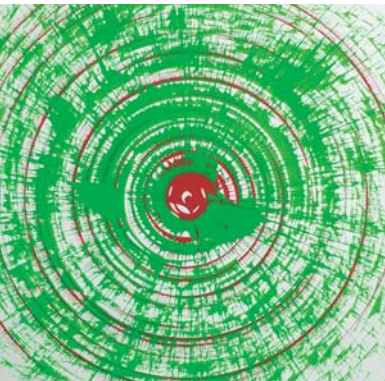




HALBJAHRESBERICHT Veri Multi Asset Allocation

vom 01.01.2017 bis 30.06.2017
Veritas Investment GmbH

Veritas Investment GmbH
mainBuilding
Taunusanlage 18
60325 Frankfurt am Main

Handelsregister:
Frankfurt HRB 34125

Geschäftsführung:
Hauke Hess
Dr. Dirk Rogowski
Hosnia Said

www.veritas-investment.de



VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Zusammengefasste Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2017

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien			
- Deutschland	EUR	566.198,50	0,53
- Euro-Länder	EUR	3.712.365,81	3,50
- Sonstige EU/EWR-Länder	EUR	3.386.758,78	3,19
- Nicht EU/EWR-Länder	EUR	14.038.267,73	13,25
2. Anleihen			
- Pfandbriefe	EUR	13.776.371,00	12,99
- Unternehmensanleihen	EUR	23.394.428,08	22,07
3. Investmentanteile			
- Aktienfonds	EUR	5.709.061,60	5,38
- Indexfonds	EUR	4.503.895,32	4,25
4. Derivate			
- Futures (Verkauf)	EUR	120.320,00	0,11
- Futures (Kauf)	EUR	-48.839,54	-0,04
5. Bankguthaben			
- Bankguthaben in EUR	EUR	13.091.695,89	12,35
- Bankguthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	51.912,84	0,05
- Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR	2.017.881,10	1,90
- Tages-/Termingelder in EUR	EUR	21.028.139,03	19,83
6. Sonstige Vermögensgegenstände			
	EUR	1.040.805,36	0,99
II. Verbindlichkeiten			
1. Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-367.017,57	-0,35
III. Fondsvermögen			
	EUR	106.022.243,93	100,00*)

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2017

ISIN	Gattungs- bezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	57.957.936,39	54,67
Aktien								
DE000A0HN5C6	Deutsche Wohnen AG	STK	8.300	8.300	0	EUR 33,2950	276.348,50	0,26
DE0008402215	Hannover Rück SE	STK	2.750	0	650	EUR 105,4000	289.850,00	0,27
CH0126881561	Swiss Re AG	STK	3.630	130	500	CHF 88,3500	293.328,30	0,28
CH0008742519	Swisscom AG	STK	690	700	10	CHF 464,0000	292.824,80	0,28
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK	1.100	1.100	0	CHF 279,0000	280.696,94	0,26
FR0000120966	BIC S.A.	STK	2.700	2.700	0	EUR 104,0500	280.935,00	0,26
FR0000121261	Cie Generale ETS Michelin SCpA	STK	2.600	0	700	EUR 118,1000	307.060,00	0,29
FI0009007884	Elisa Oyj A	STK	8.420	0	3.180	EUR 33,9700	286.027,40	0,27
ES0130960018	Enagas S.A.	STK	11.200	11.200	18.625	EUR 24,9200	279.104,00	0,26
BE0974256852	Établissements Fr. Colruyt SA	STK	6.000	0	880	EUR 45,8550	275.130,00	0,26
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.	STK	41.500	41.856	16.379	EUR 7,0020	290.583,00	0,27
FI0009013403	Kone Corp. New B	STK	6.680	0	1.820	EUR 44,6800	298.462,40	0,28
ES0152503035	Mediaset Espana Comunicacion S.A.	STK	25.500	26.000	500	EUR 10,8900	277.695,00	0,26
FI0009013296	Neste Oyj	STK	8.475	0	725	EUR 34,7900	294.845,25	0,28
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A.	STK	14.700	16.357	7.124	EUR 18,5000	271.950,00	0,26
FI0009000277	Tieto Oyj	STK	10.400	0	3.800	EUR 27,1400	282.256,00	0,27
FR0000124711	Unibail-Rodamco SE	STK	1.270	0	350	EUR 222,9000	283.083,00	0,27
GB00B033F229	Centrica PLC	STK	130.000	162.101	32.101	GBP 2,0280	299.880,57	0,28
GB00BD6K4575	Compass Group PLC	STK	14.711	14.711	0	GBP 16,3300	273.253,29	0,26
GB0007908733	SSE PLC	STK	17.300	17.300	0	GBP 14,6900	289.071,26	0,27
JP3830800003	Bridgestone Corp.	STK	3.800	0	1.200	JPY 4.840,0000	142.960,47	0,13
JP3242800005	Canon Inc.	STK	4.700	0	1.600	JPY 3.816,0000	139.409,78	0,13
JP3566800003	Central Japan Railway Co.	STK	1.000	50	200	JPY 18.310,000	142.323,08	0,13
JP3551500006	Denso Corp.	STK	3.800	3.800	4.000	JPY 4.742,0000	140.065,81	0,13
JP3276000001	GSI Creos Corp.	STK	132.000	132.000	0	JPY 138,0000	141.592,43	0,13

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

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2017

ISIN	Gattungs- bezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
JP3834200002	Heiwa Corp.	STK	7.400	1.400	2.000	JPY 2.505,0000	144.087,55	0,14
JP3047610005	Hoshino Resorts REIT Inc.	STK	31	31	0	JPY 577.000,00	139.035,12	0,13
JP3046400002	Japan Hotel Investment Corp.	STK	222	232	10	JPY 79.500,000	137.185,15	0,13
JP3726800000	Japan Tobacco Inc.	STK	4.400	0	1.000	JPY 3.947,0000	134.991,62	0,13
JP3277150003	K's Holdings Corp.	STK	8.000	0	1.800	JPY 2.195,0000	136.493,36	0,13
JP3258000003	Kirin Holdings Co. Ltd.	STK	7.500	8.600	1.100	JPY 2.289,0000	133.442,47	0,13
JP3297000006	Kokuyo Co. Ltd.	STK	12.100	12.100	0	JPY 1.533,0000	144.183,16	0,14
JP3269600007	Kuraray Co. Ltd.	STK	9.000	0	3.300	JPY 2.038,0000	142.571,82	0,13
JP3742600004	NHK Spring Co. Ltd.	STK	15.400	15.400	0	JPY 1.181,0000	141.370,12	0,13
JP3756200006	Nifco Inc.	STK	3.000	3.000	0	JPY 6.030,0000	140.613,03	0,13
JP3694400007	Nippon Kayaku Co. Ltd.	STK	12.000	12.000	15.000	JPY 1.590,0000	148.308,27	0,14
JP3188200004	Otsuka Corp.	STK	2.700	0	1.100	JPY 6.970,0000	146.279,53	0,14
JP3309000002	Penta-Ocean Constr. Co. Ltd.	STK	29.000	31.000	2.000	JPY 639,0000	144.040,91	0,14
JP3230500009	Sawai Pharmaceutical Co. Ltd.	STK	3.000	0	400	JPY 6.310,0000	147.142,33	0,14
JP3358200008	Shimamura Co. Ltd.	STK	1.200	1.200	0	JPY 13.760,000	128.347,28	0,12
JP3371200001	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	STK	1.800	1.800	2.400	JPY 10.185,0000	142.501,86	0,13
JP3396350005	SKY Perfect JSAT Holdings Inc.	STK	36.900	37.000	100	JPY 483,0000	138.535,32	0,13
JP3404200002	Sumitomo Rubber Industries Ltd.	STK	9.300	0	1.900	JPY 1.896,0000	137.059,23	0,13
JP3590900001	Token Corp.	STK	1.700	1.700	0	JPY 13.820,000	182.618,16	0,17
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc.	STK	3.800	100	300	JPY 4.651,0000	137.377,92	0,13
JP3573000001	Tokyo Gas Co. Ltd.	STK	36.000	36.000	0	JPY 584,3000	163.502,87	0,15
JP3579800008	Tokyo Steel Manufacturing, Co. Ltd.	STK	20.500	20.500	0	JPY 951,0000	151.537,94	0,14
JP3621000003	Toray Industries Inc.	STK	20.000	2.000	4.000	JPY 940,3000	146.178,48	0,14
JP3635500006	Trusco Nakayama Corp.	STK	7.500	7.500	8.400	JPY 2.683,0000	156.411,59	0,15
JP3725400000	Zeon Corp.	STK	15.700	15.700	0	JPY 1.197,0000	146.076,65	0,14
NO0003096208	Leroy Seafood Group	STK	63.200	63.200	0	NOK 45,8200	302.033,74	0,28
NO0010310956	Salmar ASA	STK	12.000	12.000	0	NOK 205,7000	257.453,52	0,24
SE0006993770	Axfood AB	STK	20.500	0	4.300	SEK 139,9000	295.954,80	0,28
SE0000379190	Castellum A.B.	STK	22.000	23.700	1.700	SEK 123,5000	280.377,69	0,26
SE0000950636	Fabege A.B.	STK	17.300	17.300	0	SEK 161,6000	288.496,98	0,27
SE0000106270	H & M Hennes & Mauritz A.B. B	STK	10.800	12.000	1.200	SEK 214,9000	239.504,67	0,23
SE0000170375	Hufvudstaden A.B. A	STK	19.300	0	5.200	SEK 139,7000	278.232,29	0,26
SE0000108847	Lundbergforetagen AB	STK	4.200	0	1.900	SEK 668,5000	289.737,37	0,27
SE0000667925	Telia Company AB	STK	72.800	72.800	0	SEK 38,9700	292.762,60	0,28
US88579Y1010	3M Co.	STK	1.700	40	380	USD 207,8500	309.232,92	0,29
IE00B4BNMY34	Accenture PLC	STK	2.650	50	400	USD 122,9900	285.234,76	0,27
US0010551028	Aflac Inc.	STK	4.460	40	900	USD 77,6000	302.888,90	0,29
US0200021014	Allstate Corp.	STK	3.600	3.600	0	USD 88,1300	277.659,83	0,26
US0220951033	Altria Group Inc.	STK	4.430	130	1.200	USD 74,4000	288.445,28	0,27
US00206R1023	AT & T Inc.	STK	8.560	1.000	1.400	USD 37,6200	281.824,88	0,27
CH0044328745	Chubb Ltd.	STK	2.320	2.320	0	USD 144,9700	294.342,45	0,28
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	STK	10.000	10.000	10.800	USD 31,4100	274.887,32	0,26
US1941621039	Colgate-Palmolive Co.	STK	4.300	0	1.200	USD 74,1200	278.927,06	0,26
US1266501006	CVS Health Corp.	STK	4.300	200	500	USD 80,2700	302.070,63	0,28
US2371941053	Darden Restaurants Inc.	STK	5.200	0	1.100	USD 91,7600	417.583,69	0,39
US3703341046	General Mills Inc.	STK	5.800	5.800	0	USD 54,9700	279.023,32	0,26
US3724601055	Genuine Parts Co.	STK	3.600	3.600	0	USD 91,1200	287.080,03	0,27
US4404521001	Hormel Foods Corp.	STK	9.600	9.600	0	USD 33,9600	285.315,71	0,27
US4581401001	Intel Corp.	STK	10.000	10.000	0	USD 33,5400	293.528,20	0,28
US4781601046	Johnson & Johnson	STK	2.553	60	690	USD 132,6400	296.354,89	0,28
US4943681035	Kimberly-Clark Corp.	STK	2.550	2.550	0	USD 129,0000	287.883,43	0,27
US5398301094	Lockheed Martin Corp.	STK	1.210	30	270	USD 276,7300	293.041,00	0,28
US5801351017	McDonald's Corp.	STK	2.200	2.200	0	USD 153,1300	294.828,69	0,28
US6668071029	Northrop Grumman Corp.	STK	1.300	1.300	0	USD 254,8800	289.978,56	0,27
US7181721090	Philip Morris International Inc.	STK	2.743	0	1.300	USD 117,0800	281.057,58	0,27
US7433151039	Progressive Corp.	STK	7.700	7.700	10.682	USD 44,1500	297.514,55	0,28
US8545021011	Stanley Black & Decker Inc.	STK	2.440	0	560	USD 139,6300	298.164,09	0,28
US89417E1091	The Travelers Companies Inc.	STK	2.696	60	400	USD 126,3900	298.208,06	0,28
US8725401090	TJX Companies Inc.	STK	4.510	420	670	USD 71,0800	280.550,30	0,26
US8910271043	Torchmark Corp.	STK	4.450	350	900	USD 76,3200	297.224,87	0,28
US92343V1044	Verizon Communications Inc.	STK	7.192	800	700	USD 44,4100	279.522,79	0,26

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

ISIN	Gattungs- bezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Verzinsliche Wertpapiere									
DE000A2AAX45	0,100% WL Bank PF 31.08.26	EUR	1.300	1.300	0	%	96,0000	1.248.000,00	1,18
DE000NLB85X6	0,250% NORD/LB ÖPF 28.10.26	EUR	1.000	1.000	0	%	95,9030	959.030,00	0,90
DE000BHY0MQ1	0,375% Berlin Hyp HPF 21.02.25	EUR	1.000	1.000	0	%	99,3570	993.570,00	0,94
DE000HSH5Y29	0,375% HSH Nordbank HPF 27.04.23	EUR	900	900	0	%	99,2390	893.151,00	0,84
DE000A2AAW53	0,500% DG HYP PF 30.09.26	EUR	1.000	1.000	0	%	98,5760	985.760,00	0,93
DE000MHB13J7	0,500% Münchener Hypothekenbank HPF 14.03.25	EUR	1.000	1.000	0	%	100,3870	1.003.870,00	0,95
DE000A14J5J4	0,500% WL BANK HPF 01.04.27	EUR	1.300	1.300	0	%	97,9210	1.272.973,00	1,20
DE000CZ40JR9	1,000% Commerzbank ÖPF 25.06.18	EUR	1.000	1.000	0	%	101,3390	1.013.390,00	0,96
		EUR	1.000	1.000	0	%	105,3270	1.053.270,00	0,99
XS0828235225	1,750% Linde MTN 17.09.20	EUR	706	0	0	%	105,4480	744.462,88	0,70
DE000MHB06J1	1,750% Münchener Hypothekenbank HPF 03.06.22	EUR	2.000	0	0	%	108,2190	2.164.380,00	2,04
DE000A1R0XG3	2,000% BASF MTN 05.12.22	EUR	1.131	0	0	%	108,5680	1.227.904,08	1,16
XS0775280166	2,000% Helaba ÖPF 26.04.19	EUR	2.100	0	0	%	104,2370	2.188.977,00	2,06
XS1109802303	1,000% Vodafone Group MTN 11.09.20	EUR	1.000	0	0	%	102,0290	1.020.290,00	0,96
FR0011437367	1,250% Danone MTN 06.06.18	EUR	700	0	0	%	101,2790	708.953,00	0,67
XS1139315581	1,375% Total Capital International MTN 19.03.25	EUR	400	0	0	%	103,9790	415.916,00	0,39
DE000A1G85B4	1,500% Siemens Financieringsmaatschappij MTN	EUR	706	0	0	%	104,1390	735.221,34	0,69
XS0866278921	1,875% Carrefour MTN 19.12.17	EUR	706	0	0	%	100,9620	712.791,72	0,67
XS0878010718	1,875% Innogy Finance MTN 30.01.20	EUR	530	0	0	%	104,4940	553.818,20	0,52
XS1176079843	1,966% ENEL Finance International MTN 27.01.25	EUR	700	0	0	%	106,1960	743.372,00	0,70
XS0760139773	2,000% Roche Finance Europe MTN 25.06.18	EUR	706	0	0	%	102,1180	720.953,08	0,68
XS0875796541	2,125% Deutsche Telekom Internation. Finance MTN	EUR	883	0	0	%	106,5870	941.163,21	0,89
XS0811554962	2,125% Heineken MTN 04.08.20	EUR	706	0	0	%	105,9700	748.148,20	0,71
FR0011261916	2,250% Engie MTN 01.06.18	EUR	706	0	0	%	102,1790	721.383,74	0,68
XS0825855751	2,250% Fortum MTN 06.09.22	EUR	706	0	0	%	107,3230	757.700,38	0,71
FR0011372622	2,375% Auchan Holding MTN 12.12.22	EUR	500	0	0	%	108,8520	544.260,00	0,51
FR0011318658	2,750% E.D.F. MTN 10.03.23	EUR	800	0	0	%	111,2930	890.344,00	0,84
XS0747744232	2,994% BP Capital Markets MTN 18.02.19	EUR	883	0	0	%	104,8200	925.560,60	0,87
XS0729046218	3,250% BMW Finance MTN 14.01.19	EUR	883	0	0	%	104,9950	927.105,85	0,87
IT0004869985	3,625% Atlantia OBL 30.11.18	EUR	706	0	0	%	105,1070	742.055,42	0,70
FR0010957662	3,641% Bouygues Bds. 29.10.19	EUR	750	0	0	%	108,1680	811.260,00	0,77
XS0543354236	3,750% Koninklijke KPN MTN 21.09.20	EUR	706	0	0	%	110,9250	783.130,50	0,74
FR0011182641	3,875% E.D.F. MTN 18.01.22	EUR	1.200	0	0	%	115,9390	1.391.268,00	1,31
XS0563306314	3,875% Orange EMTN 14.01.21	EUR	850	0	0	%	112,5490	956.666,50	0,90
XS0829183614	3,875% Snam MTN 19.03.18	EUR	1.059	0	0	%	102,7840	1.088.482,56	1,03
XS0874864860	3,987% Telefonica Emisiones MTN 23.01.23	EUR	1.100	0	0	%	116,9560	1.286.516,00	1,21
XS0741137029	4,250% ENI MTN 03.02.20	EUR	706	0	0	%	110,4970	780.108,82	0,74
XS0767977811	4,250% Iberdrola International MTN 11.10.18	EUR	900	0	0	%	105,4830	949.347,00	0,90
FR0011400571	4,561% Casino, Guichard-Perrachon MTN 25.01.23	EUR	500	0	0	%	113,2490	566.245,00	0,53
Sonstige Beteiligungswertpapiere									
CH0012032048	Roche Holding AG GEN	STK	1.210	0	390	CHF	245,4000	271.581,84	0,26
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	916.453,51	0,86	
Aktien									
US12673P1057	CA Inc.	STK	10.400	400	1.500	USD	34,2700	311.913,53	0,29
US3021301094	Expeditors International of Washington Inc.	STK	6.100	400	800	USD	55,9600	298.740,65	0,28
US74144T1088	T. Rowe Price Group Inc.	STK	4.720	100	230	USD	74,0300	305.799,33	0,29
Investmentanteile						EUR	10.212.956,92	9,63	
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile									
LU1239760454	DB Platinum IV - Dividend Equity Risk Control	ANT	50.380	50.380	0	EUR	113,3200	5.709.061,60	5,38
IE00B66F4759	iShares - Euro High Yield Corporate Bond ETF	ANT	41.924	0	0	EUR	107,4300	4.503.895,32	4,25
Summe Wertpapiervermögen **)						EUR	69.087.346,82	65,16	

**) Die Wertpapiere des Investmentvermögens sind teilweise als Sicherheitsleistung für derivative Geschäfte gesperrt

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Gattungs- bezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate								
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)								
Aktienindex-Derivate						EUR	64.944,11	0,06
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Aktienindex-Terminkontrakte								
E-Mini S&P 500 Index Future 09/17	NAR	USD	Anzahl	1.600			-25.064,54	-0,02
EURO STOXX 50 Index Future 09/17	EDT	EUR	Anzahl	-1.040			104.000,00	0,09
Nikkei 225 Yen-Denominated Index Future CME 09/17	NAR	JPY	Anzahl	12.000			-13.991,35	-0,01
Zins-Derivate						EUR	6.536,35	0,01
Forderungen/Verbindlichkeiten								
Zinsterminkontrakte								
6,000% 5-Year U.S. Treasury Notes Future 09/17	NAU	USD		15.900.000			-9.783,65	-0,01
6,000% Euro Bobl Future 09/17	EDT	EUR		-1.600.000			16.320,00	0,02
Bankguthaben						EUR	36.189.628,86	34,13
EUR-Guthaben bei:								
Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)			EUR	13.091.695,89		% 100,0000	13.091.695,89	12,35
Guthaben Tagesgeld (bei anderen Kreditinstituten)			EUR	21.028.139,03		% 100,0000	21.028.139,03	19,83
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)			DKK	79.137,20		% 100,0000	10.642,16	0,01
			GBP	11.306,73		% 100,0000	12.860,98	0,01
			NOK	101.900,99		% 100,0000	10.628,25	0,01
			SEK	172.311,12		% 100,0000	17.781,45	0,02
Guthaben in Nicht EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)			AUD	1.304,64		% 100,0000	876,77	0,00
			CAD	12.604,73		% 100,0000	8.492,61	0,00
			CHF	5.717,79		% 100,0000	5.229,61	0,00
			HKD	784.807,70		% 100,0000	87.999,20	0,08
			JPY	116.279.835,		% 100,0000	903.839,69	0,86
			SGD	132.139,09		% 100,0000	83.794,09	0,08
			USD	1.059.978,28		% 100,0000	927.649,13	0,88
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	1.040.805,36	0,99
Dividendenansprüche			EUR	56.685,16			56.685,16	0,06
Einschüsse (Initial Margin)			EUR	552.289,10			552.289,10	0,52
Quellensteueransprüche			EUR	107.172,20			107.172,20	0,10
Zinsansprüche			EUR	324.658,90			324.658,90	0,31
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-367.017,57	-0,35
Kostenabgrenzung			EUR	-147.778,27			-147.778,27	-0,14
Variation Margin			EUR	-84.360,89			-84.360,89	-0,08
Sonstiger Aufwand Geldmarktprodukte			EUR	-134.878,41			-134.878,41	-0,13
Fondsvermögen						EUR	106.022.243,93	100,00 *)
Anteilwert Veri Multi Asset Allocation (R)								
Anteilwert Veri Multi Asset Allocation (I)						EUR		141,74
Anteilwert Veri Multi Asset Allocation (W)						EUR		1.111,59
Anteilwert Veri Multi Asset Allocation (A)						EUR		97,72
Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation (R)						EUR		998,32
Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation (I)						STK		729,244
Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation (W)						STK		2.336
Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation (A)						STK		200
						STK		40

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

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 29.06.2017
Australische Dollar	(AUD)	1,488000 = 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,879150 = 1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,436200 = 1 Euro (EUR)
Hongkong Dollar	(HKD)	8,918350 = 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	128,650950 = 1 Euro (EUR)
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,484200 = 1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	9,587750 = 1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	9,690500 = 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	1,093350 = 1 Euro (EUR)
Singapur-Dollar	(SGD)	1,576950 = 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,142650 = 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörse

EDT
NAR
NAU

EUREX Terminbörse Deutschland
Chicago Mercantile Exchange
Chicago Board of Trade

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte,
soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen
(Marktzugordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungs- bezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
DE0005501357	Axel Springer SE	STK	0	8.100
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK	9.300	9.300
DE000A0S8488	Hamburger Hafen und Logistik AG	STK	0	5.451
DE0006335003	Krones AG	STK	2.900	2.900
DE0008430026	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG	STK	0	1.980
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE	STK	7.500	7.500
DE000TLX1005	Talanx AG	STK	0	11.000
ES0111845014	Abertis Infraestructuras S.A.	STK	5.537	5.537
IT0001207098	ACEA S.p.A.	STK	6.468	6.468
FR0010340141	Aéroports de Paris	STK	0	985
JP3122800000	Amada Holdings Co. Ltd.	STK	0	16.100
US0236081024	Ameren Corp.	STK	0	2.080
US0495601058	Atmos Energy Corp.	STK	0	1.380
US0533321024	Autozone Inc.	STK	0	460
JP3778630008	Bandai Namco Holdings Inc.	STK	5.000	5.000
US0718131099	Baxter International Inc.	STK	0	8.160
CH0130293662	BKW AG	STK	0	2.210
BE0974268972	bpost S.A.	STK	0	16.300
JP3243600008	Canon Marketing Japan Inc.	STK	0	11.000
HK0002007356	CLP Holdings Ltd	STK	0	10.080
GB00BLNN3L44	Compass Group PLC	STK	15.300	15.300
US2091151041	Consolidated Edison Inc.	STK	0	1.360
NL0010583399	Corbion N.V.	STK	12.100	12.100
GB00BYZXW769	Croda International PLC	STK	7.100	7.100
DK0060655629	DFDS A.S.	STK	0	9.000
JP3548600000	Disco Corp.	STK	0	1.600
US26138E1091	Dr. Pepper Snapple Group Inc.	STK	0	4.050
ES0112501012	Ebro Puleva S.A.	STK	15.500	15.500
US2810201077	Edison International Holding	STK	1.079	1.079
BE0003822393	Elia System Operator S.A./N.V.	STK	0	2.050
ES0130670112	Endesa S.A.	STK	0	22.312
US30040W1080	Eversource Energy	STK	1.457	1.457
AT0000741053	EVN AG	STK	6.752	6.752
CH0319416936	Flughafen Zürich AG	STK	0	2.663
US3448491049	Foot Locker Inc.	STK	0	4.700

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

ISIN	Gattungs- bezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
JP3046200006	Frontier Real Estate Investment	STK	35	35
ES0116870314	Gas Natural SDG S.A.	STK	0	5.565
FR0010040865	Gecina S.A.	STK	0	2.780
CH0001752309	Georg Fischer AG	STK	0	450
US4198701009	Hawaiian Electric Industries Inc.	STK	0	3.038
BMG4593F1389	Hiscox Ltd.	STK	23.900	23.900
JP3678800008	Hitachi High-Technologies Corp.	STK	0	4.800
JP3786200000	Hitachi Metals Ltd.	STK	11.000	11.000
KYG459951003	Hopewell Highway Infrastructure Ltd.	STK	0	193.951
JP3047760008	Invesco Office J-Reit Inc.	STK	0	222
JP3386450005	JXTG Holdings Inc.	STK	35.700	35.700
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.V.	STK	0	18.200
CH0025238863	Kuehne & Nagel International AG	STK	0	2.820
JP3247090008	KYORIN Holdings Inc.	STK	0	8.600
JP3869010003	Matsumotokiyo Holdings Co. Ltd.	STK	0	3.600
GB00BDR05C01	National Grid PLC	STK	6.428	6.428
GB00B08SNH34	National Grid PLC New	STK	0	8.525
CH0038863350	Nestlé S.A.	STK	0	5.400
JP3729400006	Nippon Express Co. Ltd.	STK	0	35.000
JP3762900003	Nomura Real Estate Holdings Inc.	STK	9.500	9.500
JP3180400008	Osaka Gas Co. Ltd.	STK	0	25.527
US7234841010	Pinnacle West Capital Corp.	STK	0	1.350
US69351T1060	PPL Corp.	STK	0	2.970
US7445731067	Public Service Enterprise Group Inc.	STK	0	2.440
US7617131062	Reynolds American Inc	STK	0	6.600
US7743411016	Rockwell Collins Inc.	STK	0	3.800
FR0000073272	Safran S.A.	STK	0	5.200
FI0009003305	Sampo PLC A	STK	0	8.000
US80589M1027	SCANA Corp.	STK	1.265	1.265
FR0010411983	Scor SE	STK	0	11.000
JP3351150002	Shizuoka Gas Co. Ltd.	STK	13.225	13.225
IT0003201198	SIAS Soc. Iniziative Autostradali e Servizi S.p.A.	STK	0	11.909
SG1I52882764	Singapore Airport Terminal Services Ltd.	STK	0	29.879
JP3396210001	Skylark Co. Ltd.	STK	10.200	10.200
IT0003153415	Snam S.p.A.	STK	0	121.269
US87612E1064	Target Corp.	STK	0	4.800
IT0003242622	Terna S.p.A.	STK	0	22.629
US4370761029	The Home Depot Inc.	STK	2.100	2.100
JP3955800002	The Yokohama Rubber Co. Ltd.	STK	0	10.000
JP3600200004	Toho Gas Co. Ltd	STK	0	12.000
JP3552260006	Tokai Holdings Corp.	STK	0	14.880
JP3629000005	Toppan Printing Co. Ltd.	STK	0	19.000
JP3634200004	Toyoda Gosei Co. Ltd.	STK	0	8.000
US9113121068	United Parcel Service Inc. B	STK	0	3.060
US92240G1013	Vectren Corp.	STK	0	1.920
US98389B1008	Xcel Energy Inc.	STK	0	2.500
BMG982941046	XL Group Ltd.	STK	0	9.800
Verzinsliche Wertpapiere				
DE000BHY1216	1,375% Berlin Hyp HPF 30.05.17	EUR	0	900
DE000HV2AAX3	2,625% UniCredit Bank PF 31.05.17	EUR	0	2.200
XS0503579459	2,875% Helaba ÖPF 21.04.17	EUR	0	900
DE000A1A6PY8	3,375% Deutsche Pfandbriefbank ÖPF 18.01.17	EUR	0	1.000
XS0805582011	3,755% Gaz Capital LPN 15.03.17	EUR	0	988
XS0747771128	4,125% Terna MTN 17.02.17	EUR	0	883
FR0011164888	4,125% Vinci MTN 20.02.17	EUR	0	700
XS0829360923	6,000% Gas Natural Capital Markets MTN 27.01.20	EUR	0	500
Andere Wertpapiere				
ES06445809D9	Iberdrola S.A. ANR	STK	16.023	16.023

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

ISIN	Gattungs- bezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
IT0004093263	Ascopiave S.p.A.	STK	0	36.119
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
JP3428600005	Tonengeneral Sekiyu Co. Ltd.	STK	0	16.000
Investmentanteile				
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
IE00B2NPKV68	iShares II PLC - J.P.Morgan \$ EM Bond UCITS ETF	ANT	0	43.291

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

Gattungs- bezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
--------------------------	---	-------------------	----------------------	---------------------

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswerte: E-Mini S&P 500 Index Future,

EURO STOXX 50 Index Future,

Nikkei 225 Yen-Denominated Index Future CME)

EUR

24.672

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswerte: EURO STOXX 50 Index Future)

EUR

1.197

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:

(Basiswerte: 5-Year U.S. Treasury Notes Future)

EUR

25.258

Verkaufte Kontrakte:

(Basiswerte: Euro Bobl Future)

EUR

3.161

SONSTIGE ANGABEN

Sondervermögen Veri Multi Asset Allocation

Anteilklassen-Bezeichnung	(R)	(I)
Mindestanlagesumme	keine	1.000.000,00 EUR
Fondsaufgabe	03.08.1970	19.02.2014
Ausgabeaufschlag	5,00%	0,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	1,40%	0,70%
Erfolgsbezogene Zusatzvergütung	10% des eine Wertentwicklung von 4% p.a. übersteigenden Betrages (High Watermark)	10% des eine Wertentwicklung von 4% p.a. übersteigenden Betrages (High Watermark)
Kostenpauschale p.a.	0,30%	0,30%
Stückelung	Globalurkunde	Globalurkunde
Ertragsverwendung	thesaurierend	thesaurierend
Währung	EUR	EUR
ISIN	DE0009763235	DE000A0MKQQ4

Anteilklassen-Bezeichnung	(W)	(A)
Mindestanlagesumme	keine	1.000.000,00
Fondsaufgabe	18.03.2015	01.07.2015
Ausgabeaufschlag	5,00%	0,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	1,40%	0,70%
Erfolgsbezogene Zusatzvergütung	keine	10% des eine Wertentwicklung von 4% p.a. übersteigenden Betrages (High Watermark)
Kostenpauschale p.a.	0,30%	0,30%
Stückelung	Globalurkunde	Globalurkunde
Ertragsverwendung	thesaurierend	ausschüttend
Währung	EUR	EUR
ISIN	DE000A1W2AF2	DE000A114514

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Während des Berichtszeitraumes wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

Anteilwert Veri Multi Asset Allocation (R)	EUR	141,74
Anteilwert Veri Multi Asset Allocation (I)	EUR	1.111,59
Anteilwert Veri Multi Asset Allocation (W)	EUR	97,72
Anteilwert Veri Multi Asset Allocation (A)	EUR	998,32
Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation (R)	STK	729.244
Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation (I)	STK	2.336
Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation (W)	STK	200
Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation (A)	STK	40

SONSTIGE ANGABEN

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die von der Verwahrstelle übermittelten Bewertungskurse für die einzelnen Wertpapiere bzw. Derivate werden von der Veritas Investment GmbH als verantwortliche Stelle für die Anteilpreisermittlung mittels unabhängiger Referenzkurse von Informationsdienstleistern wie Bloomberg, Reuters oder Interactive Data stichprobenartig geprüft.

Im Fall von handelbaren Wertpapieren erfolgt die Bewertung zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs. Wertpapiere, für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden im Rahmen eines mehrstufigen Prozesses einer detaillierten Kursprüfung unterzogen, wobei folgende Grundsätze gelten:

- Wertpapiere, für die in Bloomberg kein Kurs bereitgestellt wird, oder deren Kurs länger als 10 Bewertungstage konstant ist, werden als nicht mehr handelbar eingestuft. Die von der Verwahrstelle für diese Wertpapiere gelieferten Kurse werden mittels Quotierungen Dritter oder anhand von Preisen auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen plausibilisiert.
- Ein Wechsel der Kursquelle erfolgt nur bei dauerhafter Verfügbarkeit der neuen Quelle.
- Steht als Kursquelle ausschließlich ein mittels Bewertungsmodell errechneter Preis zur Verfügung, wird dieser Preis anhand eines weiteren unabhängigen Bewertungsmodells verifiziert (Einhaltung des Zwei-Quellen-Prinzips).

Die Bewertung von Investmentanteilen erfolgt grundsätzlich auf Basis des Rücknahmepreises des Vortages oder - sofern kein Rücknahmepreis verfügbar ist - auf Basis von Börsenkursen. Exchange-Traded-Funds werden zum Börsenkurs bewertet.

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Nicht börsengehandelte Derivate (wie z.B. Devisentermingeschäfte oder Swaps) werden mittels marktgängiger Verfahren unter Einbeziehung der relevanten Marktinformationen bewertet.

Bankguthaben und sonstige Vermögensgegenstände sind zum Nennwert bewertet. Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

Veritas Investment GmbH
Geschäftsführung

ANGABEN ZUR GESELLSCHAFT

Veritas Investment GmbH

mainBuilding
Taunusanlage 18
60325 Frankfurt am Main
Telefon: +49 (0) 69. 97 57 43 -0
Telefax: +49 (0) 69. 97 57 43 -81
E-Mail: info@veritas-investment.de
Internet: www.veritas-investment.de

Haftendes Eigenkapital
€ 2,6 Mio., Stand 31.12.2016
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
€ 2,6 Mio., Stand 31.12.2016

Gesellschafter

Veritas Portfolio GmbH & Co. KG,
Frankfurt am Main

Geschäftsführer

Hauke Hess, 22397 Hamburg
Dr. Dirk Rogowski, 22941 Bargteheide
Hosnia Said, 61440 Oberursel

Verwahrstelle

Zweigstelle Frankfurt am Main der
Société Générale S.A., Paris
Neue Mainzer Straße 46–50
60311 Frankfurt am Main
Haftendes Eigenkapital: € 63,6 Mrd.,
Stand 31.12.2016

Wirtschaftsprüfer

FFA Frankfurt Finance Audit GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft,
Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Günther Skrzypek
Verwaltungsrat
Augur Financial Opportunity SICAV,
Luxemburg
Vorsitzender

Florian Gräber
Verwaltungsrat
Augur Financial Opportunity SICAV,
Luxemburg
Stellvertretender Vorsitzender

Dr. Siegfried Jaschinski
Vorstand
Augur Capital AG,
Frankfurt am Main

Verbandsmitglied bei

BVI Bundesverband
Investment und Asset Management e.V.,
Frankfurt am Main

Veritas Investment GmbH
mainBuilding
Taunusanlage 18
60325 Frankfurt am Main

Telefon: +49 (0) 69. 97 57 43 -0
Telefax: +49 (0) 69. 97 57 43 -81
E-Mail: info@veritas-investment.de
Internet: www.veritas-investment.de

