



HALBJAHRESBERICHT Veri ETF-Dachfonds

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. Investmentanteile			
- Alternative Investmentfonds	EUR	1.729.626,02	1,73
- Indexfonds	EUR	90.316.460,03	90,31
2. Bankguthaben			
- Bankguthaben in EUR	EUR	8.063.614,14	8,06
- Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR	127.037,24	0,13
- Tages-/Termingelder in EUR	EUR	10.000,00	0,01
II. Verbindlichkeiten			
1. Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-240.408,55	-0,24
III. Fondsvermögen			
	EUR	100.006.328,88	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
Investmentanteile						EUR	92.046.086,05	92,04
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile								
FR0012903235	Amundi ETF Japan Topix UCITS ETF	ANT	78.920	11.700	24.120	EUR 71,6400	5.653.828,80	5,65
FR0011020965	Amundi ETF MSCI EM Asia A	ANT	218.940	460.670	241.730	EUR 26,5100	5.804.099,40	5,80
FR0010959676	Amundi MSCI Emerging Markets ETF	ANT	2.338.400	4.658.400	2.320.000	EUR 3,7680	8.811.091,20	8,81
LU0378449770	ComStage ETF-NASDAQ 100 I	ANT	64.180	0	64.970	EUR 51,5140	3.306.168,52	3,31
LU0322252338	db x-trackers - MSCI Pacific ex Japan ETF [DR] 1C	ANT	49.770	17.800	57.860	EUR 48,8100	2.429.273,70	2,43
LU0292106167	db x-trackers DBLCl - OY Balanced ETF 1C	ANT	18.268	0	0	EUR 16,9900	310.373,32	0,31
LU0292109005	db x-trackers MSCI EM Emea Index ETF 1C	ANT	180.990	449.520	268.530	EUR 23,9800	4.340.140,20	4,34
LU0292108619	db x-trackers MSCI EM Latam Index ETF 1C	ANT	114.350	261.350	147.000	EUR 36,1500	4.133.752,50	4,13
LU0322253906	db x-trackers MSCI Euro. Small Cap Index ETF DR	ANT	93.045	47.250	69.270	EUR 40,6500	3.782.279,25	3,78
LU0274210672	db x-trackers MSCI USA Index ETF 1C	ANT	161.400	287.010	293.620	EUR 55,8400	9.012.576,00	9,01
DE000A0Q8NE4	ETFs Russell 2000 US Small Cap GO ETF	ANT	64.800	91.750	118.700	EUR 50,9300	3.300.264,00	3,30
DE000A0D8Q49	iShares DJ U.S. Select Dividend ETF (DE)	ANT	34.610	54.830	102.860	EUR 57,3600	1.985.229,60	1,99
IE00B0M63284	iShares PLC - European Property Yield ETF	ANT	43.020	56.250	13.230	EUR 39,1000	1.682.082,00	1,68
DE0005933998	iShares STOXX Europe Mid 200 ETF (DE)	ANT	84.350	43.120	60.350	EUR 44,2500	3.732.487,50	3,73
IE00B1FZ5F77	iShares US Property Yield ETF	ANT	19.980	99.980	95.000	EUR 25,0000	499.500,00	0,50
FR0010378604	Lyxor ETF STOXX Europe Select Dividend 30	ANT	101.480	0	43.110	EUR 16,5750	1.682.031,00	1,68
FR0010429068	Lyxor MSCI Emerging Markets ETF	ANT	929.520	1.999.120	1.069.600	EUR 9,5130	8.842.523,76	8,84
FR0010296061	Lyxor MSCI USA ETF D EUR	ANT	4.870	48.930	79.380	EUR 204,5800	996.304,60	1,00
LU0259321452	Market Access - RICI Agriculture Index ETF	ANT	6.000	0	0	EUR 76,9600	461.760,00	0,46
LU0259320728	Market Access - RICI Metals Index ETF	ANT	9.010	0	10.210	EUR 106,2700	957.492,70	0,96
IE00B60SX394	Source Markets - Source MSCI World ETF	ANT	221.980	0	9.200	EUR 45,8500	10.177.783,00	10,18
IE00B60SX402	Source Markets - Source Russell 2000 ETF	ANT	19.760	85.360	149.860	EUR 58,1600	1.149.241,60	1,15
LU0136234654	UBS ETF - MSCI USA UCITS ETF A	ANT	19.630	24.760	51.660	EUR 204,3000	4.010.409,00	4,01
LU0446734104	UBS-ETF - MSCI Europe UCITS ETF A	ANT	78.190	97.370	71.940	EUR 63,7600	4.985.394,40	4,99
Summe Wertpapiervermögen						EUR	92.046.086,05	92,04

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

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Bankguthaben					EUR	8.200.651,38	8,20
EUR-Guthaben bei:							
Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)	EUR	8.063.614,14			% 100,0000	8.063.614,14	8,06
Guthaben Tagesgeld (bei anderen Kreditinstituten)	EUR	10.000,00			% 100,0000	10.000,00	0,01
Guthaben in Nicht EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)	JPY	44.767,00			% 100,0000	347,97	0,00
	USD	144.761,50			% 100,0000	126.689,27	0,13
Sonstige Verbindlichkeiten					EUR	-240.408,55	-0,24
Kostenabgrenzung	EUR	-150.495,41				-150.495,41	-0,15
Sonstiger Aufwand Geldmarktprodukte	EUR	-4.326,23				-4.326,23	0,00
Verbindlichkeiten aus Anteilschneingeschäften	EUR	-85.586,91				-85.586,91	-0,09
Fondsvermögen					EUR	100.006.328,88	100,00 *)
Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (P)					EUR	14,67	
Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (I)					EUR	15,78	
Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (W)					EUR	11,87	
Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (P)					ANT	6.646.372	
Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (I)					ANT	155.281	
Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (W)					ANT	1.835	

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 29.06.2017
Japanische Yen	(JPY)	128,650950 = 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,142650 = 1 Euro (EUR)

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Investmentanteile				
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile				
LU1291109616	BNP P. Easy Energy & Metals Enhanced Roll	ANT	0	89.770
IE00B4L5Y983	iShares III PLC - Core MSCI World UCITS ETF USD	ANT	214.800	436.570
FR0010261198	Lyxor ETF MSCI Europe	ANT	149.600	149.600
FR0010315770	Lyxor ETF MSCI WORLD FCP	ANT	5.970	11.970
FR0007063177	Lyxor ETF Nasdaq 100	ANT	284.700	512.210

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

SONSTIGE ANGABEN

Sondervermögen Veri ETF-Dachfonds

Anteilklassen-Bezeichnung	(P)	(I)
Mindestanlagesumme	keine	1.000.000 EUR
Fondsaufgabe	02.04.2007	16.04.2008
Ausgabeaufschlag	0,00%	0,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	1,50%	0,60%
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	DE0005561674	DE000A0MKQL5

Anteilklassen-Bezeichnung	(W)
Mindestanlagesumme	keine
Fondsaufgabe	02.09.2013
Ausgabeaufschlag	5,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	1,50%
Erfolgsbezogene Zusatzvergütung	keine
Kostenpauschale p.a.	0,30%
Stückelung	Globalurkunde
Ertragsverwendung	thesaurierend
Währung	EUR
ISIN	DE000A0MKQH3

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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

Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (P)	EUR	14,67
Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (I)	EUR	15,78
Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (W)	EUR	11,87
Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (P)	ANT	6.646.372
Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (I)	ANT	155.281
Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (W)	ANT	1.835

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

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

