

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2017

Strategie Welt Secur

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie
über die Entwicklung des offenen inländischen Publikums-AIF
(Gemischte Investmentvermögen)

Strategie Welt Secur

in der Zeit vom 1. Januar 2017 bis 30. Juni 2017.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von + 3,79 %.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Investmentvermögens im Detail per Ende Juni darstellte. Im Rahmen des nächsten Jahresberichtes erhalten Sie zudem einen umfangreichen Marktbericht. Abseits dessen stehen wir Ihnen aber auch für weitere Fragen gern zur Verfügung und verbleiben

mit herzlichen Grüßen

Ihre
HANSAINVEST-Geschäftsführung

Nicholas Brinckmann, Marc Drießen, Dr. Jörg W. Stotz

Hamburg, im August 2017

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensaufstellung per 30. Juni 2017	4
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	9

Vermögensaufstellung per 30. Juni 2017

Fondsvermögen: EUR 5.307.784,63 (4.927.434,33)

Umlaufende Anteile: 245.157 (235.599)

Vermögensübersicht zum 30.06.2017			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien	99.356,23	1,87	(3,00)
2. Anleihen	519.623,44	9,79	(12,13)
3. Zertifikate	205.080,00	3,87	(4,16)
4. Sonstige Wertpapiere	3.644.373,08	68,66	(69,38)
5. Derivate	-338.709,50	-6,39	(-4,59)
6. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	200.004,30	3,77	(1,41)
7. Bankguthaben	1.002.209,91	18,88	(14,77)
8. Sonstige Vermögensgegenstände	8.297,70	0,16	(0,27)
II. Verbindlichkeiten	-32.450,53	-0,61	(-0,53)
III. Fondsvermögen	5.307.784,63	100,00	

(Angaben in Klammern per 31.12.2016)

Vermögensaufstellung zum 30.06.2017

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					Verkäufe/ Abgänge				
im Berichtszeitraum									
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Deutsche Lufthansa	DE0008232125		STK	35	0	0	EUR 19,795000	692,83	0,01
Uniper	DE000UNSE018		STK	520	0	0	EUR 16,545000	8.603,40	0,16
Volkswagen Vorzugsaktien	DE0007664039		STK	300	0	0	EUR 133,000000	39.900,00	0,75
Verzinsliche Wertpapiere									
0,858000000% AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 04(09/Und.)	XS0203470157		EUR	100	0	0	% 78,606500	78.606,50	1,48
6,500000000% Berentzen-Gruppe IHS 12/17	DE000A1RE1V3		EUR	21	0	0	% 101,445000	21.303,45	0,40
3,750000000% Deutsche Postbank EO-FLR 04/09	DE000A0DHUM0		EUR	100	0	0	% 101,014000	101.014,00	1,90
1,090000000% ING Groep N.V. EO-FLR Bonds 2003(13/Und.)	NL0000113587		EUR	50	0	0	% 84,672500	42.336,25	0,80
6,500000000% Rudolf Wöhrl AG Anleihe v.2013(2018)	DE000A1R0YA4		EUR	50	0	0	% 16,740000	8.370,00	0,16
Zertifikate									
Commerzbank AG Fakt.1xLongZ.11(11/unl.)VST0XX	DE000CZ34KS8		STK	1.000	0	0	EUR 4,560000	4.560,00	0,09
Commerzbank AG UNL.ZT15(15/unl)Fondsindex	DE000CB1WBS6		STK	2.000	0	0	EUR 100,260000	200.520,00	3,78
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	505.906,43	9,53
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									
Aktien									
Singulus Technologies	DE000A1681X5		STK	5.280	0	0	EUR 9,500000	50.160,00	0,95
Verzinsliche Wertpapiere									
7,000000000% SAF HOLLAND EO-SV 12/18	DE000A1HA979		EUR	80	0	0	% 105,180000	84.144,00	1,59
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere							EUR	134.304,00	2,54
Nicht notierte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
3,500000000% AIV S.A. Compartment 22 EO-Notes 2016(26)	XS1524568679		EUR	100	0	0	% 101,048794	101.048,79	1,90
5,750000000% DIC Asset AG Anleihe v.13/18	DE000A1TNJ22		EUR	70	0	0	% 104,143500	72.900,45	1,37
3,000000000% Singulus Technologies 16/21	DE000A2AA5H5		EUR	11	0	0	% 90,000000	9.900,00	0,19
Summe der nicht notierten Wertpapiere							EUR	183.849,24	3,46
Investmentanteile									
Gruppenfremde Investmentanteile 2)									
ComStage ETF - DAX TR	LU0378438732		ANT	7.500	0	0	EUR 121,560000	911.700,00	17,18
DB x-tr.II Eonia Tot. Ret. Index 1C	LU0290358497		ANT	500	0	0	EUR 138,425000	69.212,50	1,30
db x-trackers LEVDAX DAILY ETF 1C	LU0411075376		ANT	4.000	0	0	EUR 117,030000	468.120,00	8,82
INVESCO Pan European High Income	LU0243957239		ANT	5.500	0	0	EUR 21,690000	119.295,00	2,25
iShares DAX UCITS ETF DE	DE0005933931		ANT	9.100	0	500	EUR 108,020000	982.982,00	18,52
SKAG Euroinvest Corporates	DE000A0MYQX1		ANT	67.000	0	0	EUR 13,080000	876.360,00	16,51
DB X-TRACKERS S&P 500 ETF 1C	LU0490618542		ANT	5.800	0	0	USD 42,685000	216.703,58	4,08
Summe der Investmentanteile							EUR	3.644.373,08	68,66
Summe Wertpapiervermögen							EUR	4.468.432,75	84,19

Vermögensaufstellung zum 30.06.2017

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2017	Käufe/ Zugänge		Ver- käufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum						
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)											
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten											
Optionsrechte											
Optionsrechte auf Aktienindices											
Call DAX 10550,000000000 15.09.2017	DE0008469495		STK	-35						-330.977,50	-6,24
Put DAX 5th Friday 12600,000000000 30.06.2017	DE000A0G9C96		STK	-8						-7.728,00	-0,15
Call DAX 5th Friday 12900,000000000 30.06.2017	DE000A0G9C96		STK	-8						-4,00	0,00
Summe der Aktienindex-Derivate									EUR	-338.709,50	-6,39
Bankguthaben und Geldmarktfonds											
Bankguthaben											
EUR - Guthaben bei:											
Verwahrstelle: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG			EUR	1.002.209,91						1.002.209,91	18,88
Summe der Bankguthaben									EUR	1.002.209,91	18,88
Gruppenfremde Geldmarktfonds											
Deutsche Floating Rate Notes Inhaber-Anteile o.N.	LU0034353002		ANT	2.370	2.370	0	EUR	84,390000		200.004,30	3,77
Summe der Geldmarktfonds									EUR	200.004,30	3,77
Sonstige Vermögensgegenstände											
Zinsansprüche			EUR	8.297,70						8.297,70	0,16
Summe sonstige Vermögensgegenstände									EUR	8.297,70	0,16
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-32.450,53				EUR		-32.450,53	-0,61
Fondsvermögen									EUR	5.307.784,63	100*
Anteilwert									EUR	21,65	
Umlaufende Anteile									STK	245.157	

Fußnoten:

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

1) noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Investmentvermögens 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 Investmentvermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)			per 30.06.2017
US-Dollar	USD	1,142450	= 1 Euro (EUR)
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					
Commerzbank	DE000CBK1001	STK	-	6.000	
E.ON SE	DE000ENAG999	STK	-	5.200	
Verzinsliche Wertpapiere					
5,375000000% Lafarge EO-MTN 07/17	XS0307005545	EUR	-	100	
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Optionsrechte					
Wertpapier-Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktien					
Verkaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswerte: E.ON SE, Volkswagen Vorzugsaktien, Commerzbank		EUR			6,10
Verkaufte Verkaufsoptionen(Put):					
Basiswerte: Deutsche Telekom, Daimler, E.ON SE, HUGO BOSS, Royal Dutch Shell, Bayer, Total S.A., Deutsche Lufthansa, Continental		EUR			23,08
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices:					
Verkaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: DAX Index		EUR			258,83
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: DAX Index		EUR			27,30

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 1.603.476,44

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

BHF-Bank AG
Bank of New York Mellon SA/NV
Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	84,19
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-6,39

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	21,65
Umlaufende Anteile	STK	245.157

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

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Investmentvermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütung und Aufwandsersstattungen. Die KVG gewährt sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Investmentvermögen an sie geleisteten Vergütung.

Verwaltungsvergütungssatz für im Investmentvermögen gehaltene Investmentanteile

2) Die Verwaltungsvergütung für Gruppenfremde Investmentanteile beträgt:

ComStage ETF - DAX TR	0,1200% p.a.
DB x-tr.II Eonia Tot. Ret. Index 1C	0,1500% p.a.
db x-trackers LEVDAX DAILY ETF 1C	0,3500% p.a.
INVESCO Pan European High Income	1,2500% p.a.
iShares DAX UCITS ETF DE	0,1500% p.a.
SKAG Euroinvest Corporates	0,4000% p.a.
DB X-TRACKERS S&P 500 ETF 1C	0,0500% p.a.

Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge wurden nicht berechnet.

Angaben zur Mitarbeitervergütung für das Geschäftsjahr 2016

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer):	EUR 14.500.104,02
davon fix:	EUR 11.907.583,74
davon variabel:	EUR 2.592.520,28
Zahl der Mitarbeiter der KVG: 193	
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr 2016 der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker (nur Führungskräfte):	EUR 1.201.000,08

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:
€ 11.306.775,13
Haftendes Eigenkapital:
€ 14.184.724,34
(Stand: 31.12.2016)

Gesellschafter:

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

Verwahrstelle:

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 16.000.000,00
Haftendes Eigenkapital:
€ 161.968.555,32
(Stand 31.12.2016)

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