



HALBJAHRESBERICHT Börsenampel Fonds Global

vom 01.12.2017 bis 31.05.2018

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 31. Mai 2018

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände			
1. Anleihen			
- Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden	EUR	6.037.496,00	81,52
2. Derivate			
- Futures (Verkauf)	EUR	-94.650,00	-1,28
- Futures (Kauf)	EUR	-33.404,79	-0,45
3. Bankguthaben			
- Bankguthaben in EUR	EUR	193.742,96	2,62
- Bankguthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	1,08	0,00
- Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR	315.240,03	4,26
- Tages-/Termingelder in EUR	EUR	159.908,12	2,16
4. Sonstige Vermögensgegenstände	EUR	842.406,56	11,37
II. Verbindlichkeiten			
1. Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-14.701,74	-0,20
III. Fondsvermögen		EUR	7.406.038,22
			100,00*)

Vermögensaufstellung zum 31. Mai 2018

ISIN	Gattungs- bezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere								EUR	6.037.496,00	81,52
Verzinsliche Wertpapiere										
DE000A1KRBD1	0,000% Hessen LSA 25.04.19V		EUR	400	0	0	% 100,4510	401.804,00	5,43	
DE0001102390	0,500% BRD Anl. 15.02.26		EUR	1.100	900	0	% 103,2780	1.136.058,00	15,34	
DE0001102424	0,500% BRD Anl. 15.08.27		EUR	900	1.100	200	% 102,1230	919.107,00	12,41	
DE0001141687	1,000% BRD BO 22.02.19		EUR	450	0	0	% 101,2500	455.625,00	6,15	
DE000A1RET23	1,250% KfW Anl. 17.10.19		EUR	500	0	0	% 102,3960	511.980,00	6,91	
DE0001135499	1,500% BRD Anl. 04.09.22		EUR	600	0	0	% 108,3660	650.196,00	8,78	
DE0001135408	3,000% BRD Anl. 04.07.20		EUR	600	0	0	% 107,8630	647.178,00	8,74	
DE0001135440	3,250% BRD Anl. 04.07.21		EUR	800	0	0	% 112,1110	896.888,00	12,11	
DE0001135382	3,500% BRD Anl. 04.07.19		EUR	400	0	200	% 104,6650	418.660,00	5,65	
Summe Wertpapiervermögen (**)								EUR	6.037.496,00	81,52
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
Aktienindex-Derivate								EUR	-33.404,79	-0,45
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte										
	DAX Index Future 06/18	EDT	EUR	Anzahl	125			-8.437,50	-0,11	
	E-Mini S&P 500 Index Future 06/18	NAR	USD	Anzahl	750			-25.147,01	-0,34	
	EURO STOXX 50 Index Future 06/18	EDT	EUR	Anzahl	510			-7.010,00	-0,09	
	Tokyo Stock Price Index Future 06/18	FJO	JPY	Anzahl	130.000			7.189,72	0,10	
Zins-Derivate								EUR	-94.650,00	-1,28
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Zinsterminkontrakte										
	6,000% Euro Bobl Future 06/18	EDT	EUR		-1.600.000			-37.120,00	-0,50	
	6,000% Euro Bund Future 06/18	EDT	EUR		-1.100.000			-57.530,00	-0,78	

*) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.
**) Die Wertpapiere des Investmentvermögens sind teilweise als Sicherheitsleistung für derivative Geschäfte gesperrt.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

ISIN	Gattungs- bezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben							EUR	668.892,19	9,04
EUR-Guthaben bei:									
	Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)		EUR 193.742,96				% 100,0000	193.742,96	2,62
	Guthaben Tagesgeld (bei anderen Kredit- instituten)		EUR 159.908,12				% 100,0000	159.908,12	2,16
	Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)								
			GBP 0,94				% 100,0000	1,08	0,00
	Guthaben in Nicht EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)								
			JPY 15.233.511,00				% 100,0000	121.021,76	1,63
			USD 224.594,00				% 100,0000	194.218,27	2,63
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	842.406,56	11,37
	Einschüsse (Initial Margin)		EUR 642.712,87					642.712,87	8,68
	Quellensteueransprüche		EUR 8.821,02					8.821,02	0,12
	Variation Margin		EUR 121.024,73					121.024,73	1,63
	Zinsansprüche		EUR 69.847,94					69.847,94	0,94
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-14.701,74	-0,20
	Kostenabgrenzung		EUR -6.802,26					-6.802,26	-0,09
	Sonstiger Aufwand Geldmarktprodukte		EUR -44,48					-44,48	0,00
	Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR -7.855,00					-7.855,00	-0,11
Fondsvermögen							EUR	7.406.038,22	100,00 *)
Anteilwert Börsenampel Fonds Global (R)							EUR	34,78	
Anteilwert Börsenampel Fonds Global (I)							EUR	1.150,26	
Umlaufende Anteile Börsenampel Fonds Global (R)							STK	52.638	
Umlaufende Anteile Börsenampel Fonds Global (I)							STK	4.847	

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.05.2018
Britische Pfund	(GBP)	0,871400 = 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	125,874150 = 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,156400 = 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörse
EDT
FJO
NAR

EUREX Terminbörse Deutschland
Osaka
Chicago Mercantile Exchange

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	Gattungs- bezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
DE000NRW0E35	0,000% Nordrhein-Westfalen LSA 15.07.20V	EUR	0	500
DE000SHFM444	0,000% Schleswig-Holstein LSA 01.12.23V	EUR	0	500

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

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

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

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
Terminkontrakte			Volumen in 1.000
Aktienindex-Terminkontrakte			
Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: DAX Index Future, E-Mini S&P 500 Index Future, EURO STOXX 50 Index Future, Tokyo Stock Price Index Future)	EUR		14.828
Zinsterminkontrakte			
Verkaufte Kontrakte: (Basiswerte: Euro Bobl Future, Euro Bund Future)	EUR		4.721

SONSTIGE ANGABEN

Sondervermögen Börsenampel Fonds Global

Anteilklassen-Bezeichnung	(R)	(I)
Mindestanlagesumme	keine	1.000.000 EUR
Fondsaufgabe	02.12.1996	18.03.2014
Ausgabeaufschlag	5,00%	0,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	1,00%	0,70%
Erfolgsbezogene Zusatzvergütung	keine	keine
Kostenpauschale p.a.	0,3%	0,3%
Stückelung	Globalurkunde	Globalurkunde
Ertragsverwendung	ausschüttend	ausschüttend
Währung	EUR	EUR
ISIN	DE0009763268	DE000A1W2AE5

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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

Anteilwert Börsenampel Fonds Global (R)	EUR	34,78
Anteilwert Börsenampel Fonds Global (I)	EUR	1.150,26
Umlaufende Anteile Börsenampel Fonds Global (R)	STK	52.638
Umlaufende Anteile Börsenampel Fonds Global (I)	STK	4.847

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.

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 31.12.2017
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
€ 2,6 Mio., Stand 31.12.2017

Gesellschafter

Veritas Portfolio GmbH & Co. KG,
Frankfurt am Main

Geschäftsführer

Hauke Hess, 22397 Hamburg
Dr. Dirk Rogowski, 22941 Bargtheide
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: € 60,0 Mrd.,
Stand 31.12.2017

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

