

Halbjahresbericht zum 31. Mai 2018

D&R SpeedLab eQuant Income



Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

D&R SpeedLab eQuant Income

in der Zeit vom 15. Januar 2018 bis 31. Mai 2018.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von - 1,71 % in der Anteilklasse I sowie von - 1,96 % in der Anteilklasse P.

Die Anteilklasse V wurde am 31.05.2018 aufgelegt.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Investmentvermögens im Detail per Ende Mai 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 Juni 2018

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensaufstellung per 31. Mai 2018	4
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	9

Vermögensaufstellung per 31. Mai 2018

Fondsvermögen: EUR 16.096.710,02

Umlaufende Anteile: I-Klasse 84.331

P-Klasse 74.536

V-Klasse 5.000

Vermögensaufteilung in TEUR/%		
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	8.099	50,32
2. Derivate	-22	-0,14
3. Bankguthaben	8.032	49,90
4. Sonstige Vermögensgegenstände	13	0,08
II. Verbindlichkeiten		
	-25	-0,16
III. Fondsvermögen	16.097	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.05.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2018	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
0,000000000% Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2014(2019)R.125	DE0001040996		EUR	900	900	0	% 100,631000	905.679,00	5,63
0,000000000% Berlin FLR-Landessch. A.378 12/19	DE000A1MLYD2		EUR	500	500	0	% 100,398000	501.990,00	3,12
0,000000000% Berlin, Land FLR-Landessch.v.13(2021) A.411	DE000A1TNF42		EUR	500	1.000	500	% 101,823500	509.117,50	3,16
0,000000000% Bremen, Freie Hansestadt FLR-LandSchatz.A.188 v.13(20)	DE000A1K0V76		EUR	500	500	0	% 101,025000	505.125,00	3,14
0,000000000% DNB Boligkredit A.S. EO-FLR M.-T. Pfandbr. 14/21	XS1137512742		EUR	500	500	0	% 101,105500	505.527,50	3,14
0,000000000% European Investment Bank EO-FLR MTN 13/21	XS0907250509		EUR	500	500	0	% 101,710500	508.552,50	3,16
2,500000000% European Investment Bank EO-MTN 10/19	XS0541909213		EUR	500	500	0	% 103,832845	519.164,23	3,23
0,074000000% Hamburg, Freie und Hansestadt FLR-LandSchatz.anw.A.1 16(20)	DE000A1YQJ9		EUR	800	800	0	% 101,070000	808.560,00	5,02
0,000000000% Hessen FLR-Schatzanw. 12/19	DE000A1KRBD1		EUR	500	500	0	% 100,475000	502.375,00	3,12
1,250000000% K.F.W. 12/19	DE000A1RET23		EUR	500	500	0	% 102,404835	512.024,18	3,18
0,000000000% NATIXIS Pfandbriefbank AG FLR-MTN-HPF Ser.17 v.14(20)	DE000A1YC1M5		EUR	500	500	0	% 100,610000	503.050,00	3,13
0,000000000% Nordrhein-Westfalen, Land FLR-Landessch.v.15(20) R.1381	DE000R-RW0HM6		EUR	500	500	0	% 101,436000	507.180,00	3,15
0,000000000% Schleswig-Holstein, Land FLR-Landesschatz.v.15(21) A.1	DE000SHFM477		EUR	500	500	0	% 101,748000	508.740,00	3,16
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	7.297.084,91	45,34
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
0,000000000% Rheinland-Pfalz, Land FLR-Landessch.v.2012(2019)	DE000RLP0272		EUR	800	800	0	% 100,297500	802.380,00	4,98
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere							EUR	802.380,00	4,98
Summe Wertpapiervermögen							EUR	8.099.464,91	50,32
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Derivate auf einzelne Wertpapiere									
Wertpapier-Terminkontrakte									
Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten									
Euro-Schatz-Future 07.06.2018	DE0009652669			-25				-5.875,00	-0,04
Euro-Schatz-Future 07.06.2018	DE0009652669			-25				-5.375,00	-0,03
Five-Year U.S. Treasury Notes Futures 29.06.2018	US12573H3104			-30				-11.505,80	-0,07
Long Gilt Futures (No.7) 26.09.2018	XC000A1XRBZ9			10				685,95	0,00
U.S.A.Treasury Bond (Long) Futures 19.09.2018	US12573H2601			10				5.113,69	0,03
Ten-Year U.S. Treasury Notes Futures 19.09.2018	US12573H3286			-25				-5.382,84	-0,03
OAT 07.06.2018	DE000A1MAPW3			10				800,00	0,00
Euro Bund Futures 07.06.2018	DE0009652644			10				-600,00	0,00
Summe der Derivate auf einzelne Wertpapiere							EUR	-22.139,00	-0,14

Vermögensaufstellung zum 31.05.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2018	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	1.877.496,66				1.877.496,66	11,67
Bank: National-Bank AG			EUR	3.100.000,00				3.100.000,00	19,26
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	3.048.433,86				3.048.433,86	18,94
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen:									
			GBP	48.508,33				55.457,10	0,34
Summe der Bankguthaben							EUR	8.081.387,62	50,21
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	12.745,63				12.745,63	0,08
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	12.745,63	0,08
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme									
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen			USD	-57.299,73				-49.349,52	-0,31
Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-49.349,52	-0,31
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-25.399,62			EUR	-25.399,62	-0,16
Fondsvermögen							EUR	16.096.710,02	100*
Anteilwert - D&R SpeedLab eQuant Income I							EUR	98,29	
Umlaufende Anteile							STK	84.331	
Anteilwert - D&R SpeedLab eQuant Income P							EUR	98,04	
Umlaufende Anteile							STK	74.536	
Anteilwert - D&R SpeedLab eQuant Income V							EUR	100,00	
Umlaufende Anteile							STK	5.000	

Fußnoten:

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

1) noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Zinsen lfd. Konto

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Investmentvermögens über Broker ausgeführt wurden, die verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 100,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 233.342.643,00 EUR.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Investmentvermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)			per 31.05.2018
Britisches Pfund	GBP	0,874700	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,161100	= 1 Euro (EUR)
Marktschlüssel			
b) Terminbörsen			
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND		
XCBO	CHICAGO BOARD OF TRADE		
IFEU	INTERCONTINENTAL EXCHANGE		
XCME	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)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,000000000% Bremen, Freie Hansestadt FLR-LandSchatz.A.190 v.14/19	DE000A1K0V92	EUR	500	500	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,000000000% Rheinland-Pfalz, Land FLR-Landessch.v.2014(2019)	DE000RLP0629	EUR	500	500	
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Wertpapier-Terminkontrakte					
Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten					
Gekaufte Kontrakte:					
Basiswerte: Bundesrep.Deutschland Euro-SCHATZ synth. Anleihe, 8,5-10,5Yr. French Government Bonds (synth. Anleihe), Bundesrep. Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe, Bundesrep. Deutschland Euro-BOBL (synth. Anleihe), Italien		EUR			35.861,10
Basiswert: Großbritannien Long Gilt synth.Anleihe		GBP			6.961,77
Basiswerte: 5 Yr. United States of America Treasury Note synth. Anleihe, 30Yr. United States of America Treasury Bond synth.Anleihe		USD			5.166,16
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswerte: 8,5-10,5Yr. French Government Bonds (synth. Anleihe), Bundesrep.Deutschland Euro-SCHATZ synth. Anleihe, Bundesrep. Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe, Bundesrep. Deutschland Euro-BOBL (synth. Anleihe), Italien		EUR			34.416,91
Basiswert: Großbritannien Long Gilt synth.Anleihe		GBP			3.603,46
Basiswerte: 5 Yr. United States of America Treasury Note synth. Anleihe, 10Yr. United States of America Treasury Note synth.Anleihe, 30Yr. United States of America Treasury Bond synth.Anleihe		USD			16.356,82

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 16.977.937,01

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Donner & Reuschel AG

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	50,32
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,14

Sonstige Angaben

Anteilwert - D&R SpeedLab eQuant Income I	EUR	98,29
Umlaufende Anteile	STK	84.331

Anteilwert - D&R SpeedLab eQuant Income P	EUR	98,04
Umlaufende Anteile	STK	74.536

Anteilwert - D&R SpeedLab eQuant Income V	EUR	100,00
Umlaufende Anteile	STK	5.000

Anteilklasse I: Verwaltungsvergütung 0,90% p.a., Ausgabeaufschlag 3,00%, Ausgabeaufschlag 5,00%; Ertragsverwendung Thesaurierung

Anteilklasse P: Verwaltungsvergütung 1,50 % p.a., Ausgabeaufschlag 3,00%, Ausgabeaufschlag 5,00%; Ertragsverwendung Thesaurierung

Anteilklasse V: Verwaltungsvergütung 0,15 % p.a., Ausgabeaufschlag 3,00%, Ausgabeaufschlag 5,00%; Ertragsverwendung Ausschüttung

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).

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Investmentvermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandserstattungen.

Die KVG gewährt sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Investmentvermögen an sie geleisteten Vergütung.

Angaben zur Mitarbeitervergütung der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH (KVG) für das Geschäftsjahr 2017

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer): EUR 9.668.504,18

davon fix: EUR 7.731.706,47

davon variabel: EUR 1.936.797,71

Zahl der Mitarbeiter der KVG: 128

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr 2017 der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker (nur Führungskräfte): EUR 878.912,52

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 Kapital:
10.500 TEUR
Eigenmittel:
14.154 TEUR
(Stand: 31.12.2017)

Gesellschafter:

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

Verwahrstelle:

DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 20.500.000,00
Eigenmittel (Art. 72 CRR):
€ 211.062.705,72
(Stand: 31.12.2017)

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, Wedel

Dr. Thomas A. Lange,
Vorsitzender des Vorstandes der
National-Bank AG, Essen

Prof. Dr. Harald Stützer,
Geschäftsführender Gesellschafter der
STUETZER Real Estate Consulting
GmbH, Gerolsbach

Prof. Dr. Stephan Schüller,
Kaufmann

Wirtschaftsprüfer:

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft,
Hamburg

Geschäftsführung:

Nicholas Brinckmann
(zugleich Sprecher 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