



Halbjahresbericht

zum 30. Juni 2018

Quant HAIG

Ein Investmentfonds mit Sondervermögenscharakter als Umbrella (fonds commun de placement à compartiments multiples) gemäß Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils gültigen Fassung
K847



HAUCK & AUFHÄUSER

FUND SERVICES

Verwaltungsgesellschaft



HAUCK & AUFHÄUSER

PRIVATBANKIERS SEIT 1796

Verwahrstelle

Halbjahresbericht 2018

Inhalt

Management und Verwaltung	3
Erläuterungen zu den Vermögensübersichten	5
Quant HAIG-Börsenampel-Deutsche Aktien offensiv	6
Quant HAIG - DAX MinVar Flex Protection	10
Quant HAIG Konsolidierung	15



Management und Verwaltung

Verwaltungsgesellschaft

Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A.*
R.C.S. Luxembourg B 28.878
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

Aufsichtsrat

Vorsitzender

Michael Bentlage
Vorsitzender des Vorstands
Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Frankfurt am Main

Mitglieder

Marie-Anne van den Berg
Independent Director

Andreas Neugebauer
Independent Director

Vorstand

Stefan Schneider
Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A., Luxemburg

Achim Welschhoff
Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A., Luxemburg

Thomas Albert
Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A., Luxemburg

Verwahrstelle

**Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung
Luxemburg**
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

Zahl- und Informationsstellen

Großherzogtum Luxemburg

**Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung
Luxemburg**
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

Bundesrepublik Deutschland

**Zahl- und Informationsstelle Deutschland:
Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG**
Kaiserstraße 24, D-60311 Frankfurt am Main

Fondsmanager

GFA Vermögensverwaltung GmbH
Am Marktplatz 1, D-79336 Herbolzheim

Anlageberater

quantagon financial advisors GmbH
Mainzer Landstraße 49, D-60329 Frankfurt am Main

Abschlussprüfer

BDO Audit, S.A.
Cabinet de révision agréé
1, rue Jean Piret, L-2350 Luxembourg

Register- und Transferstelle

Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A.
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach

* Hauck & Aufhäuser Investment Gesellschaft S.A. (HAIG) wurde zum 27. Februar 2018 auf die Hauck & Aufhäuser Asset Management Services S.à r.l. (HAAM, ehemals Oppenheim Asset Management Services S.à r.l.) verschmolzen und die HAAM in Hauck & Aufhäuser Fund Services S.A. (HAFS) umbenannt sowie in eine Aktiengesellschaft (S.A.) umgewandelt.



Sehr geehrte Damen und Herren,

der vorliegende Bericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung des Investmentfonds Quant HAIG mit seinen Teilfonds Quant HAIG-Börsenampel-Deutsche Aktien offensiv und Quant HAIG - DAX MinVar Flex Protection.

Der Investmentfonds ist ein nach Luxemburger Recht als Umbrellafonds mit der Möglichkeit der Auflegung verschiedenerer Teilfonds in der Form eines fonds commun de placement à compartiments multiples errichtetes Sondervermögen aus Wertpapieren und sonstigen Vermögenswerten. Er wurde nach Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils gültigen Fassung ("Gesetz von 2010") aufgelegt und erfüllt die Anforderungen der geänderten Richtlinie des Rates der Europäischen Gemeinschaften Nr. 2009/65/EG vom 13. Juli 2009, zuletzt geändert durch die Richtlinie 2014/91/EU des Europäischen Parlamentes und des Rates vom 23. Juli 2014 ("Richtlinie 2009/65/EG").

Zeichnungen können nur auf Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts oder der wesentlichen Anlegerinformationen (Key Investor Information Document) zusammen mit dem Zeichnungsantragsformular, dem letzten Jahresbericht und gegebenenfalls dem letzten Halbjahresbericht erfolgen.

Wir möchten noch darauf hinweisen, dass Änderungen der Vertragsbedingungen des Sondervermögens sowie sonstige wesentliche Anlegerinformationen an die Anteilinhaber im Internet unter www.hauck-aufhaeuser.com bekannt gemacht werden. Hier finden Sie ebenfalls aktuelle Fondspreise und Fakten zu Ihren Fonds.

Der Bericht umfasst den Zeitraum vom 1. Januar 2018 bis zum 30. Juni 2018.

Wertentwicklung des Netto-Fondsvermögens im Berichtszeitraum (nach BVI-Methode exkl. Verkaufsprovision)

Quant HAIG - Börsenampel - Deutsche Aktien offensiv A	-13,16 %
Quant HAIG - DAX MinVar Flex Protection A	-7,86 %

Die Wertentwicklung ist die prozentuale Veränderung zwischen dem angelegten Vermögen am Anfang des Anlagezeitraumes und seinem Wert am Ende des Anlagezeitraumes und beruht auf der Annahme, dass etwaige Ausschüttungen wieder angelegt wurden. Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu.



zum 30. Juni 2018

Der vorliegende Bericht wurde gemäß den in Luxemburg geltenden Vorschriften erstellt.

Der Wert eines Anteils ("Anteilwert") lautet auf die im Verkaufsprospekt des jeweiligen Teilfonds festgelegte Währung der Anteilklasse ("Anteilklassenwährung"). Er wird unter Aufsicht der Verwahrstelle von der Verwaltungsgesellschaft oder einem von ihr beauftragten Dritten an jedem im Verkaufsprospekt festgelegten Tag ("Bewertungstag") berechnet. Die Berechnung des Teilfonds und seiner Anteilklassen erfolgt durch Teilung des Netto-Teilfondsvermögens der jeweiligen Anteilklasse durch die Zahl der am Bewertungstag im Umlauf befindlichen Anteile dieser Anteilklasse. Soweit in Jahres- und Halbjahresberichten sowie sonstigen Finanzstatistiken aufgrund gesetzlicher Vorschriften oder gemäß den Regelungen des Verwaltungsreglements Auskunft über die Situation des Fondsvermögens des Fonds insgesamt gegeben werden muss, erfolgen diese Angaben in Euro ("Referenzwährung"), und die Vermögenswerte werden in die Referenzwährung umgerechnet.

Das Netto-Fondsvermögen wird nach folgenden Grundsätzen berechnet:

- a) Die im Fonds enthaltenen Zielfondsanteile werden zum letzten festgestellten und erhältlichen Anteilwert bzw. Rücknahmepreis bewertet.
- b) Der Wert von Kassenbeständen oder Bankguthaben, Einlagezertifikaten und ausstehenden Forderungen, vorausbezahlten Auslagen, Bardividenden und erklärten oder aufgelaufenen und noch nicht erhaltenen Zinsen entspricht dem jeweiligen vollen Betrag, es sei denn, dass dieser wahrscheinlich nicht voll bezahlt oder erhalten werden kann, in welchem Falle der Wert unter Einschluss eines angemessenen Abschlages ermittelt wird, um den tatsächlichen Wert zu erhalten.
- c) Der Wert von Vermögenswerten, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, wird auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses ermittelt, sofern nachfolgend nichts anderes geregelt ist.
- d) Sofern ein Vermögenswert nicht an einer Börse oder auf einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird oder sofern für Vermögenswerte, welche an einer Börse oder auf einem anderen Markt wie vorerwähnt notiert oder gehandelt werden, die Kurse entsprechend den Regelungen in c) den tatsächlichen Marktwert der entsprechenden Vermögenswerte nicht angemessen widerspiegeln, wird der Wert solcher Vermögenswerte auf der Grundlage des vernünftigerweise vorhersehbaren Verkaufspreises nach einer vorsichtigen Einschätzung ermittelt.
- e) Der Liquidationswert von Futures, Forwards oder Optionen, die nicht an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, entspricht dem jeweiligen Nettoliquidationswert, wie er gemäß den Richtlinien des Vorstands auf einer konsistent für alle verschiedenen Arten von Verträgen angewandten Grundlage festgestellt wird. Der Liquidationswert von Futures, Forwards oder Optionen, welche an Börsen oder anderen organisierten Märkten gehandelt werden, wird auf der Grundlage der letzten verfügbaren Abwicklungspreise solcher Verträge an den Börsen oder organisierten Märkten, auf welchen diese Futures, Forwards oder Optionen vom Fonds gehandelt werden, berechnet; sofern ein Future, ein Forward oder eine Option an einem Tag, für welchen der Nettovermögenswert bestimmt wird, nicht liquidiert werden kann, wird die Bewertungsgrundlage für einen solchen Vertrag vom Vorstand in angemessener und vernünftiger Weise bestimmt.
- f) Swaps werden zu ihrem Marktwert bewertet. Es wird darauf geachtet, dass Swap - Kontrakte zu marktüblichen Bedingungen im exklusiven Interesse des Fonds abgeschlossen werden.
- g) Geldmarktinstrumente können zu ihrem jeweiligen Verkehrswert, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben und allgemein anerkannten, von Wirtschaftsprüfern nachprüfbar festgelegten Bewertungsregeln festlegt, bewertet werden.
- h) Sämtliche sonstige Wertpapiere oder sonstige Vermögenswerte werden zu ihrem angemessenen Marktwert bewertet, wie dieser nach Treu und Glauben und entsprechend dem der Verwaltungsgesellschaft auszustellenden Verfahren zu bestimmen ist.
- i) Die auf Wertpapiere entfallenden anteiligen Zinsen werden mit einbezogen, soweit diese nicht im Kurswert berücksichtigt wurden (Dirty - Pricing).
- j) Der Wert aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, welche nicht in der Währung des Teilfonds ausgedrückt sind, wird in diese Währung zu den zuletzt verfügbaren Devisenkursen umgerechnet. Wenn solche Kurse nicht verfügbar sind, wird der Wechselkurs nach Treu und Glauben und nach dem vom Vorstand aufgestellten Verfahren bestimmt.

Die Verwaltungsgesellschaft kann nach eigenem Ermessen andere Bewertungsmethoden zulassen, wenn sie dieses im Interesse einer angemesseneren Bewertung eines Vermögenswertes des Fonds für angebracht hält.

Wenn die Verwaltungsgesellschaft der Ansicht ist, dass der ermittelte Anteilwert an einem bestimmten Bewertungstag den tatsächlichen Wert der Anteile des Teilfonds nicht wiedergibt, oder wenn es seit der Ermittlung des Anteilwertes beträchtliche Bewegungen an den betreffenden Börsen und/oder Märkten gegeben hat, kann die Verwaltungsgesellschaft beschließen, den Anteilwert noch am selben Tag zu aktualisieren. Unter diesen Umständen werden alle für diesen Bewertungstag eingegangenen Anträge auf Zeichnung und Rücknahme auf der Grundlage des Anteilwertes eingelöst, der unter Berücksichtigung des Grundsatzes von Treu und Glauben aktualisiert worden ist.

Im Geschäftsjahr kamen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 ("SFTR") zum Einsatz. Somit sind im Jahresbericht keine Angaben im Sinne von Artikel 13 der genannten Verordnung an die Anleger aufzuführen.



Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Quant HAIG-Börsenampel-Deutsche Aktien offensiv

Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Wertpapiervermögen								8.620.941,50	93,05	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Bundesrep. Deutschland										
adidas AG Namens-Aktien o.N.		DE000A1EWWW0	Stück	1.480,00	0,00	-540,00	EUR	184,00	272.320,00	2,94
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.		DE0008404005	Stück	1.560,00	70,00	-400,00	EUR	172,70	269.412,00	2,91
BASF SE Namens-Aktien o.N.		DE000BASF111	Stück	3.530,00	110,00	-620,00	EUR	80,92	285.647,60	3,08
Bayer AG Namens-Aktien o.N.		DE000BAY0017	Stück	3.110,00	70,00	-380,00	EUR	94,27	293.179,70	3,16
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1		DE0005190003	Stück	3.360,00	30,00	-950,00	EUR	77,56	260.601,60	2,81
Beiersdorf AG Inhaber-Aktien o.N.		DE0005200000	Stück	3.260,00	90,00	-650,00	EUR	95,84	312.438,40	3,37
Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N.		DE000CBK1001	Stück	28.360,00	3.040,00	-4.870,00	EUR	8,19	232.296,76	2,51
Continental AG Inhaber-Aktien o.N.		DE0005439004	Stück	1.370,00	30,00	-360,00	EUR	197,15	270.095,50	2,92
Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.		DE0006062144	Stück	4.070,00	4.070,00	0,00	EUR	73,70	299.959,00	3,24
Daimler AG Namens-Aktien o.N.		DE0007100000	Stück	4.680,00	80,00	-660,00	EUR	55,23	258.476,40	2,79
Deutsche Bank AG Namens-Aktien o.N.		DE0005140008	Stück	26.960,00	4.140,00	0,00	EUR	9,06	244.311,52	2,64
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.		DE0005810055	Stück	2.710,00	0,00	-1.270,00	EUR	112,95	306.094,50	3,30
Deutsche Lufthansa AG vink.Namens-Aktien o.N.		DE0008232125	Stück	12.760,00	1.210,00	-1.300,00	EUR	20,55	262.218,00	2,83
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.		DE0005552004	Stück	8.470,00	280,00	-1.280,00	EUR	27,90	236.313,00	2,55
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.		DE0005557508	Stück	20.980,00	100,00	-4.080,00	EUR	13,26	278.089,90	3,00
E.ON SE Namens-Aktien o.N.		DE000ENAG999	Stück	34.140,00	0,00	-4.010,00	EUR	9,09	310.435,02	3,35
Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien o.N.		DE0005785802	Stück	3.660,00	170,00	-1.010,00	EUR	85,78	313.954,80	3,39
Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.		DE0005785604	Stück	4.810,00	170,00	-1.320,00	EUR	68,00	327.080,00	3,53
HeidelbergCement AG Inhaber-Aktien o.N.		DE0006047004	Stück	3.750,00	70,00	-340,00	EUR	72,00	270.000,00	2,91
Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N		DE0006048432	Stück	2.910,00	110,00	-490,00	EUR	106,90	311.079,00	3,36
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.		DE0006231004	Stück	14.040,00	50,00	-1.110,00	EUR	21,27	298.630,80	3,22
Linde AG z.Umtausch eing.Inhaber-Aktien		DE000A2E4L75	Stück	1.630,00	60,00	-390,00	EUR	200,50	326.815,00	3,53
Merck KGaA Inhaber-Aktien o.N.		DE0006599905	Stück	3.720,00	120,00	-530,00	EUR	82,72	307.718,40	3,32
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.		DE0008430026	Stück	1.610,00	0,00	-340,00	EUR	177,85	286.338,50	3,09
RWE AG Inhaber-Stammaktien o.N.		DE0007037129	Stück	15.340,00	80,00	-3.560,00	EUR	19,38	297.212,50	3,21
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.		DE0007164600	Stück	3.330,00	40,00	-550,00	EUR	97,28	323.942,40	3,50
Siemens AG Namens-Aktien o.N.		DE0007236101	Stück	2.920,00	40,00	-390,00	EUR	112,32	327.974,40	3,54
thyssenkrupp AG Inhaber-Aktien o.N.		DE0007500001	Stück	13.850,00	0,00	-2.940,00	EUR	20,60	285.310,00	3,08
Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.		DE0007664039	Stück	1.770,00	0,00	-390,00	EUR	143,14	253.357,80	2,73
Vonovia SE Namens-Aktien o.N.		DE000A1ML7J1	Stück	7.450,00	0,00	-1.930,00	EUR	40,22	299.639,00	3,23



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate									-51.675,00	-0,56
Derivate auf Index-Derivate										
Wertpapier-Terminkontrakte auf Aktienindices										
DAX Performance Index Future (EURX) Sep.2018	XEUR			3,00			EUR		-51.675,00	-0,56
Bankguthaben									672.709,84	7,26
EUR - Guthaben										
EUR bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				672.709,84			EUR		672.709,84	7,26
Sonstige Vermögensgegenstände									53.187,33	0,57
Sonstige Forderungen				1.512,33			EUR		1.512,33	0,02
Forderungen aus Future Variation Margin				51.675,00			EUR		51.675,00	0,56
Gesamtaktiva									9.295.163,67	100,32
Verbindlichkeiten									-30.082,33	-0,32
aus										
Fondsmanagementvergütung				-13.603,93			EUR		-13.603,93	-0,15
Prüfungskosten				-10.945,70			EUR		-10.945,70	-0,12
Risikomanagementvergütung				-550,00			EUR		-550,00	-0,01
Taxe d'abonnement				-1.158,43			EUR		-1.158,43	-0,01
Transfer- und Registerstellenvergütung				-250,00			EUR		-250,00	0,00
Verwahrstellenvergütung				-847,54			EUR		-847,54	-0,01
Verwaltungsvergütung				-2.638,34			EUR		-2.638,34	-0,03
Zinsverbindlichkeiten aus Bankguthaben				-88,39			EUR		-88,39	0,00
Gesamtpassiva									-30.082,33	-0,32
Fondsvermögen									9.265.081,34	100,00**
Inventarwert je Anteil A									106,39	
Umlaufende Anteile A									87.084,56	

**Bei der Ermittlung der Prozentwerte können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.



Marktschlüssel

Terminhandel

XEUR

Eurex Deutschland



**Anteilklasse
A in EUR**

zum 30.06.2018

Fondsvermögen	9.265.081,34
Inventarwert je Anteil	106,39
Umlaufende Anteile	87.084,556



Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Quant HAIG - DAX MinVar Flex Protection

Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Wertpapiervermögen								22.312.825,80	84,50	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Bundesrep. Deutschland										
adidas AG Namens-Aktien o.N.		DE000A1EWWW0	Stück	2.370,00	0,00	-1.890,00	EUR	184,00	436.080,00	1,65
Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N.		DE0008404005	Stück	2.570,00	0,00	-1.170,00	EUR	172,70	443.839,00	1,68
BASF SE Namens-Aktien o.N.		DE000BASF111	Stück	5.300,00	720,00	-210,00	EUR	80,92	428.876,00	1,62
Bayer AG Namens-Aktien o.N.		DE000BAY0017	Stück	4.660,00	740,00	-270,00	EUR	94,27	439.298,20	1,66
Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1		DE0005190003	Stück	11.870,00	6.690,00	-20,00	EUR	77,56	920.637,20	3,49
Beiersdorf AG Inhaber-Aktien o.N.		DE0005200000	Stück	10.180,00	1.690,00	-1.390,00	EUR	95,84	975.651,20	3,69
Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N.		DE000CBK1001	Stück	58.080,00	16.230,00	0,00	EUR	8,19	475.733,28	1,80
Continental AG Inhaber-Aktien o.N.		DE0005439004	Stück	2.070,00	0,00	-520,00	EUR	197,15	408.100,50	1,55
Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.		DE0006062144	Stück	6.070,00	8.170,00	-2.100,00	EUR	73,70	447.359,00	1,69
Daimler AG Namens-Aktien o.N.		DE0007100000	Stück	16.400,00	2.350,00	0,00	EUR	55,23	905.772,00	3,43
Deutsche Bank AG Namens-Aktien o.N.		DE0005140008	Stück	48.480,00	21.260,00	0,00	EUR	9,06	439.325,76	1,66
Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N.		DE0005810055	Stück	8.790,00	0,00	-380,00	EUR	112,95	992.830,50	3,76
Deutsche Lufthansa AG vink.Namens-Aktien o.N.		DE0008232125	Stück	26.800,00	11.750,00	0,00	EUR	20,55	550.740,00	2,09
Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N.		DE0005552004	Stück	15.200,00	4.090,00	0,00	EUR	27,90	424.080,00	1,61
Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N.		DE0005557508	Stück	74.990,00	11.510,00	-2.060,00	EUR	13,26	993.992,45	3,76
E.ON SE Namens-Aktien o.N.		DE000ENAG999	Stück	76.270,00	19.420,00	0,00	EUR	9,09	693.523,11	2,63
Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien o.N.		DE0005785802	Stück	5.310,00	80,00	-320,00	EUR	85,78	455.491,80	1,72
Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N.		DE0005785604	Stück	6.680,00	390,00	-680,00	EUR	68,00	454.240,00	1,72
HeidelbergCement AG Inhaber-Aktien o.N.		DE0006047004	Stück	13.310,00	8.150,00	0,00	EUR	72,00	958.320,00	3,63
Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N		DE0006048432	Stück	6.150,00	1.210,00	-550,00	EUR	106,90	657.435,00	2,49
Infineon Technologies AG Namens-Aktien o.N.		DE0006231004	Stück	18.570,00	700,00	-1.680,00	EUR	21,27	394.983,90	1,50
Linde AG z.Umtausch eing.Inhaber-Aktien		DE000A2E4L75	Stück	2.270,00	0,00	-1.220,00	EUR	200,50	455.135,00	1,72
Merck KGaA Inhaber-Aktien o.N.		DE0006599905	Stück	10.510,00	1.910,00	-2.170,00	EUR	82,72	869.387,20	3,29
Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N.		DE0008430026	Stück	5.610,00	320,00	0,00	EUR	177,85	997.738,50	3,78
RWE AG Inhaber-Stammaktien o.N.		DE0007037129	Stück	22.920,00	0,00	-8.740,00	EUR	19,38	444.075,00	1,68
SAP SE Inhaber-Aktien o.N.		DE0007164600	Stück	4.490,00	0,00	-2.530,00	EUR	97,28	436.787,20	1,65
Siemens AG Namens-Aktien o.N.		DE0007236101	Stück	3.890,00	580,00	-500,00	EUR	112,32	436.924,80	1,65
thyssenkrupp AG Inhaber-Aktien o.N.		DE0007500001	Stück	20.070,00	2.270,00	-1.180,00	EUR	20,60	413.442,00	1,57
Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N.		DE0007664039	Stück	2.920,00	30,00	-210,00	EUR	143,14	417.968,80	1,58
Vonovia SE Namens-Aktien o.N.		DE000A1ML7J1	Stück	24.720,00	1.930,00	-1.740,00	EUR	40,22	994.238,40	3,77



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Verzinsliche Wertpapiere										
Belgien										
Belgien, Königreich - Anleihe - 0,800 22.06.2025		BE0000334434	Nominal	750.000,00	0,00	0,00	EUR	103,79	778.417,50	2,95
Bundesrep. Deutschland										
Bundesrep.Deutschland - Anleihe - 0,250 15.02.2027		DE0001102416	Nominal	750.000,00	0,00	0,00	EUR	100,51	753.810,00	2,85
Bundesrep.Deutschland - Anleihe - 0,500 15.02.2025		DE0001102374	Nominal	750.000,00	0,00	0,00	EUR	103,73	777.945,00	2,95
Bundesrep.Deutschland - Anleihe - 1,500 04.09.2022		DE0001135499	Nominal	500.000,00	0,00	0,00	EUR	108,13	540.657,50	2,05
Bundesrep.Deutschland - Anleihe - 1,500 15.05.2023		DE0001102317	Nominal	500.000,00	0,00	0,00	EUR	108,96	544.800,00	2,06
Bundesrep.Deutschland - Anleihe - 1,750 15.02.2024		DE0001102333	Nominal	500.000,00	0,00	0,00	EUR	111,04	555.190,00	2,10
Investmentanteile*									2.237.966,84	8,48
Gruppenfremde Investmentanteile										
Irland										
OMGIS-O.M.Gl.Equ.Absol.Retu.Fd Register.Shs A EUR Hed.Acc.oN		IE00BLP5S460	Anteile	466.380,00	0,00	0,00	EUR	1,39	647.568,63	2,45
Luxemburg										
F&C Pfts Fd-BMO Gl.Eq.Mkt Neu. Actions Nom. I Dis.EUR Hd o.N.		LU1426841018	Anteile	60.670,00	0,00	0,00	EUR	10,29	624.294,30	2,36
ML Inv.Sols-MW Tops Mkt Ntrl Registered Shares B Acc.EUR oN		LU0333226826	Anteile	6.694,18	0,00	0,00	EUR	144,32	966.103,91	3,66
Derivate									505.350,00	1,91
Derivate auf einzelne Wertpapiere										
Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten										
Euro Bund Future (EURX) Sep.2018	XEUR			-28,00			EUR		-29.400,00	-0,11
Derivate auf Index-Derivate										
Wertpapier-Terminkontrakte auf Aktienindices										
DAX Performance Index Future (EURX) Sep.2018	XEUR			-31,00			EUR		534.750,00	2,03
Bankguthaben									1.904.277,13	7,21
EUR - Guthaben										
EUR bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				1.904.277,13			EUR		1.904.277,13	7,21
Sonstige Vermögensgegenstände									14.146,57	0,05
Zinsansprüche aus Wertpapieren				12.634,24			EUR		12.634,24	0,05
Sonstige Forderungen				1.512,33			EUR		1.512,33	0,01
Gesamtkтива									26.974.566,34	102,15

* Angaben zu Ausgabeaufschlägen, Rücknahmeabschlägen sowie zur maximalen Höhe der Verwaltungsgebühr für Zielfondsanteile sind auf Anfrage am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, bei der Verwahrstelle und bei den Zahlstellen kostenlos erhältlich. Der Fonds wird nicht in Zielfonds anlegen, die einer Verwaltungsvergütung von mehr als 3 % unterliegen.



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Verbindlichkeiten									-568.137,62	-2,15	
aus											
Fondsmanagementvergütung				-38.358,20				EUR	-38.358,20	-0,15	
Future Variation Margin				-505.350,00				EUR	-505.350,00	-1,91	
Prüfungskosten				-11.251,48				EUR	-11.251,48	-0,04	
Risikomanagementvergütung				-550,00				EUR	-550,00	0,00	
Taxe d'abonnement				-3.102,39				EUR	-3.102,39	-0,01	
Transfer- und Registerstellenvergütung				-250,00				EUR	-250,00	0,00	
Verwahrstellenvergütung				-2.086,49				EUR	-2.086,49	-0,01	
Verwaltungsvergütung				-6.600,73				EUR	-6.600,73	-0,02	
Zinsverbindlichkeiten aus Bankguthaben				-588,33				EUR	-588,33	0,00	
Gesamtpassiva									-568.137,62	-2,15	
Fondsvermögen									26.406.428,72	100,00**	
Inventarwert je Anteil A			EUR							110,89	
Umlaufende Anteile A			STK							238.132,83	

**Bei der Ermittlung der Prozentwerte können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.



Marktschlüssel

Terminhandel

XEUR

Eurex Deutschland



**Anteilklasse
A in EUR**

zum 30.06.2018

Fondsvermögen	26.406.428,72
Inventarwert je Anteil	110,89
Umlaufende Anteile	238.132,832



Quant HAIG Konsolidierung

Konsolidierte Vermögensübersicht Quant HAIG

zum 30. Juni 2018

	in EUR	in %
Aktiva		
Wertpapiervermögen zum Kurswert	30.933.767,30	86,72
Investmentanteile	2.237.966,84	6,27
Derivate	453.675,00	1,27
Bankguthaben	2.576.986,97	7,22
Zinsansprüche aus Wertpapieren	12.634,24	0,04
Sonstige Forderungen	3.024,66	0,01
Forderungen Future Variation Margin	51.675,00	0,14
Gesamtaktiva	36.269.730,01	101,68
Passiva		
Verbindlichkeiten aus		
Prüfungskosten	-22.197,18	-0,06
Verwahrstellenvergütung	-2.934,03	-0,01
Risikomanagementvergütung	-1.100,00	0,00
Taxe d'abonnement	-4.260,82	-0,01
Transfer- und Registerstellenvergütung	-500,00	0,00
Verwaltungsvergütung	-9.239,07	-0,03
Future Variation Margin	-505.350,00	-1,42
Fondsmanagementvergütung	-51.962,13	-0,15
Zinsverbindlichkeiten aus Bankguthaben	-676,72	0,00
Gesamtpassiva	-598.219,95	-1,68
Konsolidiertes Fondsvermögen am Ende des Geschäftsjahres	35.671.510,06	100,00*

*Bei der Ermittlung der Prozentwerte können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

