

HALBJAHRESBERICHT Veri ETF-Dachfonds

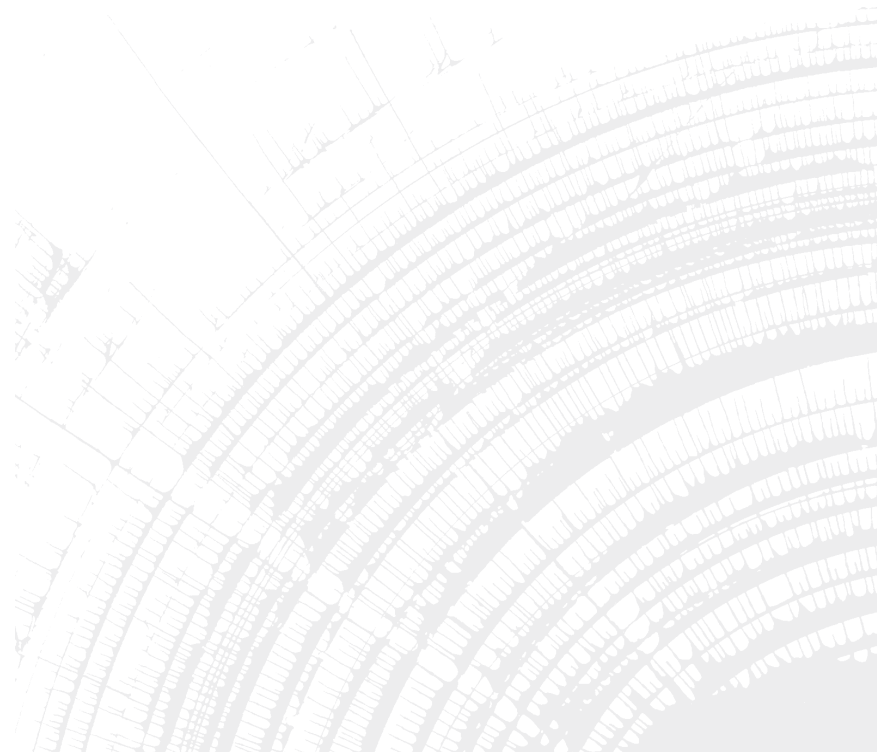
vom 01.01.2018 bis 30.06.2018
Veritas Investment GmbH

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 30. Juni 2018

| | | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|--|------------|----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | | |
| 1. Investmentanteile | | | |
| - Alternative Investmentfonds | EUR | 13.914.922,41 | 14,53 |
| - Indexfonds | EUR | 79.916.287,02 | 83,43 |
| 2. Bankguthaben | | | |
| - Bankguthaben in EUR | EUR | 1.914.261,06 | 2,00 |
| - Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen | EUR | 310.530,60 | 0,32 |
| - Tages-/Termingelder in EUR | EUR | 5.941,41 | 0,01 |
| 3. Sonstige Vermögensgegenstände | | | |
| | EUR | 1.653,10 | 0,00 |
| II. Verbindlichkeiten | | | |
| 1. Sonstige Verbindlichkeiten | EUR | -277.097,43 | -0,29 |
| III. Fondsvermögen | | | |
| | EUR | 95.786.498,17 | 100,00* |

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2018

| ISIN | Gattungs- bezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Wgh. in 1.000 | Bestand 30.06.2018 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|---|--|-------|---|-----------------------|--|----------------------|------------|----------------------|------------------------------|
| Investmentanteile | | | | | | | EUR | 93.831.209,43 | 97,96 |
| Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile | | | | | | | | | |
| LU1681044480 | AIS - MSCI EM ASIA ETF | ANT | 49.534 | 128.856 | 79.322 | EUR | 27,9262 | 1.383.296,39 | 1,44 |
| LU1681037609 | AMUNDI JAPAN TOPIX UCTIS ETF | ANT | 97.247 | 97.247 | 0 | EUR | 77,9095 | 7.576.465,15 | 7,91 |
| LU1291109616 | BNP P. Easy Energy & Metals Enhanced Roll | ANT | 639.981 | 558.581 | 4.000 | EUR | 9,6520 | 6.177.096,61 | 6,45 |
| LU0378449770 | ComStage ETF-NASDAQ 100 I | ANT | 65.315 | 0 | 6.365 | EUR | 63,5550 | 4.151.094,83 | 4,33 |
| IE00B60SX394 | Invesco Markets-MSCI World UCITS ETF | ANT | 203.980 | 0 | 18.000 | EUR | 49,8350 | 10.165.343,30 | 10,61 |
| IE00B60SX402 | Invesco Markets-Russell 2000 UCITS ETF | ANT | 71.254 | 65.489 | 76.995 | EUR | 67,1500 | 4.784.706,10 | 5,00 |
| DE000A0D8Q49 | iShares DJ U.S. Select Dividend ETF (DE) | ANT | 26.306 | 0 | 32.304 | EUR | 60,1050 | 1.581.122,13 | 1,65 |
| DE0005933998 | iShares STOXX Europe Mid 200 ETF (DE) | ANT | 82.833 | 19.318 | 20.835 | EUR | 47,4400 | 3.929.597,52 | 4,10 |
| DE000A0Q8NE4 | L&G UCITS ETF- Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | ANT | 77.363 | 12.563 | 0 | EUR | 58,7550 | 4.545.463,07 | 4,75 |
| FR0010261198 | Lyxor ETF MSCI Europe | ANT | 27.662 | 84.599 | 56.937 | EUR | 127,8500 | 3.536.586,70 | 3,69 |
| FR0007063177 | Lyxor ETF Nasdaq 100 | ANT | 239.257 | 239.257 | 285.710 | EUR | 23,8850 | 5.714.653,45 | 5,97 |
| FR0010296061 | Lyxor MSCI USA ETF D EUR | ANT | 30.544 | 30.544 | 42.040 | EUR | 226,0200 | 6.903.554,88 | 7,21 |
| LU0259321452 | Market Access - RICI Agriculture Index ETF | ANT | 19.642 | 13.642 | 0 | EUR | 71,9700 | 1.413.634,74 | 1,48 |
| LU0259320728 | Market Access - RICI Metals Index ETF | ANT | 9.010 | 0 | 0 | EUR | 109,3300 | 985.063,30 | 1,03 |
| LU0136234654 | UBS ETF - MSCI USA UCITS ETF A | ANT | 12.147 | 7.000 | 27.543 | EUR | 225,8350 | 2.743.217,75 | 2,86 |
| LU0446734104 | UBS-ETF - MSCI Europe UCITS ETF A | ANT | 120.873 | 120.873 | 78.190 | EUR | 63,1350 | 7.631.316,86 | 7,97 |
| LU0292106167 | Xtrackers - DBLCl Com. Opt. Yield Swap UCITS ETF | ANT | 286.480 | 288.212 | 20.000 | EUR | 18,6370 | 5.339.127,76 | 5,57 |
| LU0322253906 | Xtrackers - MSCI Europe Small Cap UCITS ETF | ANT | 87.350 | 20.122 | 25.817 | EUR | 44,4600 | 3.883.581,00 | 4,05 |
| LU0322252338 | Xtrackers - MSCI Pacific ex Japan UCITS ETF | ANT | 47.525 | 0 | 17.245 | EUR | 51,6550 | 2.454.903,88 | 2,56 |
| LU0274210672 | Xtrackers - Xtrackers MSCI USA Swap UCITS ETF | ANT | 142.258 | 142.258 | 161.400 | EUR | 62,7830 | 8.931.384,01 | 9,32 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | EUR | 93.831.209,43 | 97,96 |

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

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

| ISIN | Gattungs- bezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2018 | Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fonds- vermögens |
|--|---|-------|---|-----------------------|--|---|------------|----------------------|------------------------------|
| Bankguthaben | | | | | | | EUR | 2.230.733,07 | 2,33 |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| | Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle) | | EUR | 1.914.261,06 | | | % 100,0000 | 1.914.261,06 | 2,00 |
| | Guthaben Tagesgeld (bei anderen Kreditinstituten) | | EUR | 5.941,41 | | | % 100,0000 | 5.941,41 | 0,01 |
| | Guthaben in Nicht EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle) | | JPY | 44.767,00 | | | % 100,0000 | 350,31 | 0,00 |
| | | | USD | 359.126,75 | | | % 100,0000 | 310.180,29 | 0,32 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | EUR | 1.653,10 | 0,00 |
| | Forderungen aus Anteilscheingeschäften | | EUR | 1.653,10 | | | | 1.653,10 | 0,00 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | EUR | -277.097,43 | -0,29 |
| | Kostenabgrenzung | | EUR | -142.633,66 | | | | -142.633,66 | -0,15 |
| | Sonstiger Aufwand Geldmarktprodukte | | EUR | -2,87 | | | | -2,87 | 0,00 |
| | Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften | | EUR | -134.460,90 | | | | -134.460,90 | -0,14 |
| Fondsvermögen | | | | | | | EUR | 95.786.498,17 | 100,00 *) |
| Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (P) | | | | | | | EUR | 15,13 | |
| Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (I) | | | | | | | EUR | 16,41 | |
| Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (W) | | | | | | | EUR | 12,19 | |
| Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (P) | | | | | | | ANT | 6.169.924 | |
| Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (I) | | | | | | | ANT | 146.818 | |
| Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (W) | | | | | | | ANT | 1.823 | |

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 29.06.2018

Japanische Yen (JPY) 127,792200 = 1 Euro (EUR)

US-Dollar (USD) 1,157800 = 1 Euro (EUR)

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

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

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 |
|---|--|---|-------------------|----------------------|
| Investmentanteile | | | | |
| Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile | | | | |
| FR0012903235 | Amundi ETF Japan Topix UCITS ETF | ANT | 23.900 | 102.820 |
| FR0011020965 | Amundi ETF MSCI EM Asia A | ANT | 128.856 | 128.856 |
| LU1681045370 | Amundi Index Solutions-MSCI EMER. MARK. UCITS ETF | ANT | 1.943.632 | 1.943.632 |
| FR0010959676 | Amundi MSCI Emerging Markets ETF | ANT | 3.143.632 | 3.143.632 |
| DE000ETFL177 | Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany ETF | ANT | 12.095 | 12.095 |
| DE000ETFL383 | Deka iBoxx EUR Liquid Non-Financials Div. ETF | ANT | 8.362 | 8.362 |
| DE000ETFL359 | Deka iBoxx € Liquid Germany Cov Diversified ETF | ANT | 10.942 | 10.942 |
| IE00B14X4571 | iShares \$ Treasury Bond 1-3yr ETF | ANT | 5.675 | 5.675 |
| IE00B66F4759 | iShares - Euro High Yield Corporate Bond ETF | ANT | 2.838 | 2.838 |
| IE0032523478 | iShares Euro Corporate Bond Large Cap ETF | ANT | 2.240 | 2.240 |
| IE00B1FZS798 | iShares II \$ Treasury Bond 7-10yr ETF | ANT | 3.927 | 3.927 |
| IE00B2NPKV68 | iShares II PLC - J.P.Morgan \$ EM Bond UCITS ETF | ANT | 3.375 | 3.375 |
| IE00B3B8Q275 | iShares III Euro Covered Bond UCITS ETF | ANT | 3.938 | 3.938 |
| IE00B4L5Y983 | iShares III PLC - Core MSCI World UCITS ETF USD | ANT | 0 | 200.690 |
| IE00B0M63284 | iShares PLC - European Property Yield ETF | ANT | 36.716 | 79.736 |
| IE00B1FZSF77 | iShares US Property Yield ETF | ANT | 0 | 79.980 |
| FR0010378604 | Lyxor ETF STOXX Europe Select Dividend 30 | ANT | 0 | 124.480 |
| FR0010429068 | Lyxor MSCI Emerging Markets ETF | ANT | 1.298.271 | 1.298.271 |
| LU0292109005 | Xtrackers - MSCI EM Euro, M.E & Afr Swap UCITS ETF | ANT | 169.790 | 169.790 |
| LU0292108619 | Xtrackers - MSCI EM Latin America Swap UCITS ETF | ANT | 95.287 | 95.287 |

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

| Gattungs- bezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge |
|--|---|-------------------------|----------------------|
| Terminkontrakte | | | |
| Zinsterminkontrakte | | | |
| | | Volumen in 1.000 | |
| Verkaufte Kontrakte: (Basiswerte: 5-Year U.S. Treasury Notes Future, Euro Bobl Future) | EUR | | 6.003 |
| Devisenterminkontrakte | | | |
| Devisenutures | | | |
| Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: EUR/USD) | EUR | | 58.175 |

SONSTIGE ANGABEN

Sondervermögen Veri ETF-Dachfonds

| | (P) | (I) |
|---------------------------------|---|---|
| Anteilklassen-Bezeichnung | keine | 1.000.000 EUR |
| Mindestanlagesumme | 02.04.2007 | 16.04.2008 |
| Fondsaufgabe | 0,00% | 0,00% |
| Ausgabeaufschlag | 0,00% | 0,00% |
| Rücknahmeabschlag | 1,50% | 0,60% |
| Verwaltungsvergütung p.a. | 10% des eine Wertentwicklung von 4% p.a. übersteigenden Betrages (High Watermark) | 10% des eine Wertentwicklung von 4% p.a. übersteigenden Betrages (High Watermark) |
| Erfolgsbezogene Zusatzvergütung | 0,3% | 0,3% |
| Kostenpauschale p.a. | Globalurkunde | Globalurkunde |
| Stückelung | ausschüttend | ausschüttend |
| Ertragsverwendung | EUR | EUR |
| Währung | DE0005561674 | DE000A0MKQL5 |
| ISIN | | |

| | (W) |
|---------------------------------|---------------|
| Anteilklassen-Bezeichnung | keine |
| Mindestanlagesumme | 02.09.2013 |
| Fondsaufgabe | 5,00% |
| Ausgabeaufschlag | 0,00% |
| Rücknahmeabschlag | 1,50% |
| Verwaltungsvergütung p.a. | keine |
| Erfolgsbezogene Zusatzvergütung | 0,3% |
| Kostenpauschale p.a. | Globalurkunde |
| Stückelung | ausschüttend |
| Ertragsverwendung | EUR |
| Währung | DE000A0MKQH3 |
| ISIN | |

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 | 15,13 |
| Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (I) | EUR | 16,41 |
| Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (W) | EUR | 12,19 |
| Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (P) | ANT | 6.169.924 |
| Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (I) | ANT | 146.818 |
| Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (W) | ANT | 1.823 |

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
Taususanlage 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 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: € 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

