

HALBJAHRESBERICHT Veri ETF-Allocation Dynamic

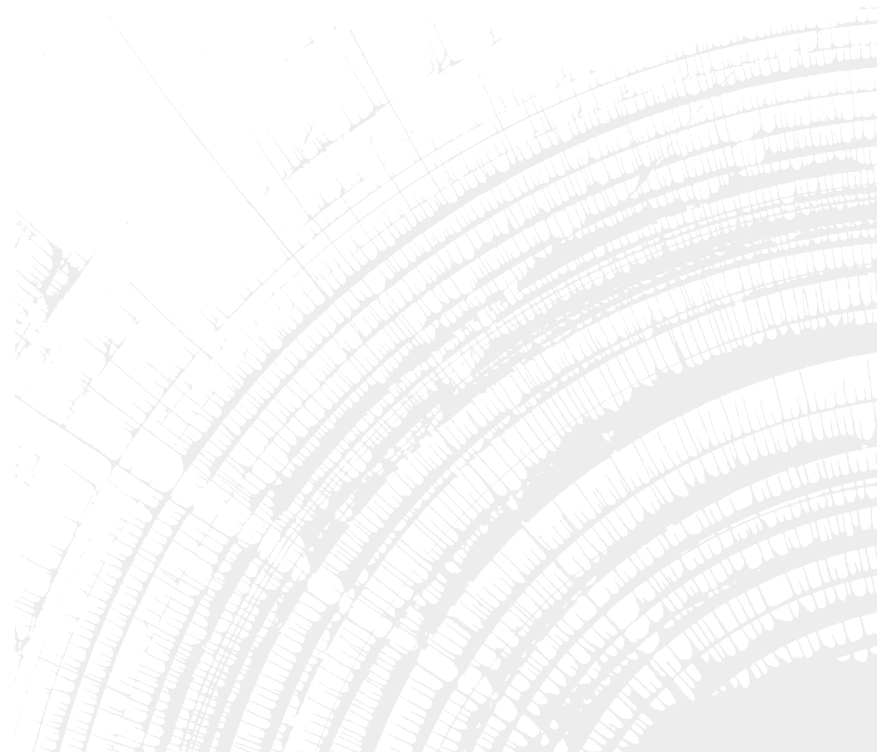
vom 01.01.2018 bis 30.06.2018
Veritas Investment GmbH

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	510.486,88	4,22
- Indexfonds	EUR	11.409.963,66	94,36
2. Bankguthaben			
- Bankguthaben in EUR	EUR	142.243,54	1,17
- Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR	51.660,93	0,43
3. Sonstige Vermögensgegenstände			
	EUR	2.281,81	0,02
II. Verbindlichkeiten			
1. Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-23.949,49	-0,20
III. Fondsvermögen			
	EUR	12.092.687,33	100,00*)

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2018

ISIN	Gattungs- bezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens	
Investmentanteile								EUR	11.920.450,54	98,58
Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile										
LU1681044480	AIS - MSCI EM ASIA ETF	ANT	8.201	14.938	6.737	0	EUR 27,9262	229.022,77	1,89	
LU1291109616	BNP P. Easy Energy & Metals Enhanced Roll	ANT	25.572	21.692	0	0	EUR 9,6520	246.820,94	2,04	
LU0378449770	ComStage ETF-NASDAQ 100 I	ANT	9.980	0	0	0	EUR 63,5550	634.278,90	5,25	
IE00B60SX394	Invesco Markets-MSCI World UCITS ETF	ANT	24.190	0	0	0	EUR 49,8350	1.205.508,65	9,97	
DE000A0D8Q49	iShares DJ U.S. Select Dividend ETF (DE)	ANT	4.310	0	3.700	0	EUR 60,1050	259.052,55	2,14	
IE00B1YZSC51	iShares II PLC - MSCI Europe UCITS ETF EUR [Dist]	ANT	9.700	0	0	0	EUR 23,7000	229.890,00	1,90	
IE00B53QDK08	iShares MSCI Japan UCITS ETF USD (Acc)	ANT	3.525	0	0	0	EUR 130,6350	460.488,38	3,81	
IE00B3VWM098	iShares MSCI USA Small Cap	ANT	1.550	0	0	0	USD 333,8500	446.940,32	3,70	
IE00B0M63284	iShares PLC - European Property Yield ETF	ANT	5.270	0	1.400	0	EUR 41,2500	217.387,50	1,80	
IE00B0M63177	iShares PLC - iShares MSCI EM UCITS ETF USD (Dist)	ANT	3.512	8.902	5.390	0	EUR 34,8900	122.533,68	1,01	
IE00B0M62Q58	iShares PLC - MSCI World ETF	ANT	939	0	0	0	EUR 38,1300	35.804,07	0,30	
DE0005933998	iShares STOXX Europe Mid 200 ETF (DE)	ANT	9.341	0	4.675	0	EUR 47,4400	443.137,04	3,66	
IE00B1FZSF77	iShares US Property Yield ETF	ANT	6.790	0	7.000	0	EUR 24,2000	164.318,00	1,36	
IE00B5BMR087	iShares VII PLC - iShares Core S&P 500	ANT	1.680	0	0	0	USD 262,6500	381.112,45	3,15	
DE000A0Q8NE4	L&G UCITS ETF- Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	ANT	13.542	10.772	12.800	0	EUR 58,7550	795.660,21	6,58	
FR0010261198	Lyxor ETF MSCI Europe	ANT	4.222	9.196	4.974	0	EUR 127,8500	539.782,70	4,46	
FR0007063177	Lyxor ETF Nasdaq 100	ANT	26.160	26.160	32.270	0	EUR 23,8850	624.831,60	5,17	
FR0010378604	Lyxor ETF STOXX Europe Select Dividend 30	ANT	14.520	0	0	0	EUR 16,3560	237.489,12	1,96	
FR0010296061	Lyxor MSCI USA ETF D EUR	ANT	3.843	3.843	5.190	0	EUR 226,0200	868.594,86	7,18	
LU0259320728	Market Access - RICI Metals Index ETF	ANT	408	0	0	0	EUR 109,3300	44.606,64	0,37	
LU0446734104	UBS-ETF - MSCI Europe UCITS ETF A	ANT	10.304	9.327	5.000	0	EUR 63,1350	650.543,04	5,38	
LU0292106167	Xtrackers - DBLCl Com. Opt. Yield Swap UCITS ETF	ANT	11.754	7.533	0	0	EUR 18,6370	219.059,30	1,81	
LU0292109005	Xtrackers - MSCI EM Euro, M.E & Afr Swap UCITS ETF	ANT	5.845	16.023	10.178	0	EUR 24,1300	141.039,85	1,17	
LU0292108619	Xtrackers - MSCI EM Latin America Swap UCITS ETF	ANT	4.387	11.613	7.226	0	EUR 34,8650	152.952,76	1,26	
LU0322253906	Xtrackers - MSCI Europe Small Cap UCITS ETF	ANT	9.887	0	4.670	0	EUR 44,4600	439.576,02	3,64	
LU0322252338	Xtrackers - MSCI Pacific ex Japan UCITS ETF	ANT	6.553	0	3.693	0	EUR 51,6550	338.495,22	2,80	
LU0274209740	Xtrackers - Xtrackers MSCI Japan UCITS ETF	ANT	13.078	14.947	8.175	0	EUR 52,2320	683.090,10	5,65	
LU0274210672	Xtrackers - Xtrackers MSCI USA Swap UCITS ETF	ANT	17.655	17.655	19.150	0	EUR 62,7830	1.108.433,87	9,17	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	11.920.450,54	98,58

*) 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	193.904,47	1,60
EUR-Guthaben bei:									
	Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)		EUR 142.243,54				% 100,0000	142.243,54	1,17
	Guthaben in Nicht EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)		USD 59.813,03				% 100,0000	51.660,93	0,43
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	2.281,81	0,02
	Forderungen aus Anteilscheingeschäften		EUR 2.281,81					2.281,81	0,02
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-23.949,49	-0,20
	Kostenabgrenzung		EUR -15.160,76					-15.160,76	-0,13
	Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften		EUR -8.788,73					-8.788,73	-0,07
Fondsvermögen							EUR	12.092.687,33	100,00 *)
Anteilwert Veri ETF-Allocation Dynamic (R)							EUR	20,24	
Anteilwert Veri ETF-Allocation Dynamic (W)							EUR	10,12	
Umlaufende Anteile Veri ETF-Allocation Dynamic (R)							ANT	596.885	
Umlaufende Anteile Veri ETF-Allocation Dynamic (W)							ANT	1.000	

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

US-Dollar (USD) per 29.06.2018
1,157800 = 1 Euro (EUR)

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				
FR0011020965	Amundi ETF MSCI EM Asia A	ANT	14.938	14.938
LU1681045370	Amundi Index Solutions-MSCI EMER. MARK. UCITS ETF	ANT	258.421	258.421
FR0010959676	Amundi MSCI Emerging Markets ETF	ANT	258.421	258.421
IE00B4LSY983	iShares III PLC - Core MSCI World UCITS ETF USD	ANT	0	24.780
FR0010315770	Lyxor ETF MSCI WORLD FCP	ANT	0	490
FR0010429068	Lyxor MSCI Emerging Markets ETF	ANT	102.569	102.569
LU0136234654	UBS ETF - MSCI USA UCITS ETF A	ANT	1.800	2.430

*) 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	Volumen in 1.000
---------------------	---------------------------------------	----------------	-------------------	------------------

Devisenterminkontrakte

Devisenfutures

Gekaufte Kontrakte:
(Basiswerte: EUR/USD)

EUR

6.299

SONSTIGE ANGABEN

Sondervermögen Veri ETF-Allocation Dynamic

Anteilklassen-Bezeichnung	(R)	(W)
Mindestanlagesumme	keine	keine
Fondsaufgabe	01.02.2002	01.04.2015
Ausgabeaufschlag	5,00%	5,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	1,20%	1,20%
Erfolgsbezogene Zusatzvergütung	10% des eine Wertentwicklung von 4% p.a. übersteigenden Betrages (High Watermark)	keine
Kostenpauschale p.a.	0,3%	0,3%
Stückelung	Globalurkunde	Globalurkunde
Ertragsverwendung	ausschüttend	ausschüttend
Währung	EUR	EUR
ISIN	DE0005561658	DE000A1W2AG0

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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

Anteilwert Veri ETF-Allocation Dynamic (R)	EUR	20,24
Anteilwert Veri ETF-Allocation Dynamic (W)	EUR	10,12
Umlaufende Anteile Veri ETF-Allocation Dynamic (R)	ANT	596.885
Umlaufende Anteile Veri ETF-Allocation Dynamic (W)	ANT	1.000

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 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

