

# HALBJAHRESBERICHT Veri Multi Asset Allocation

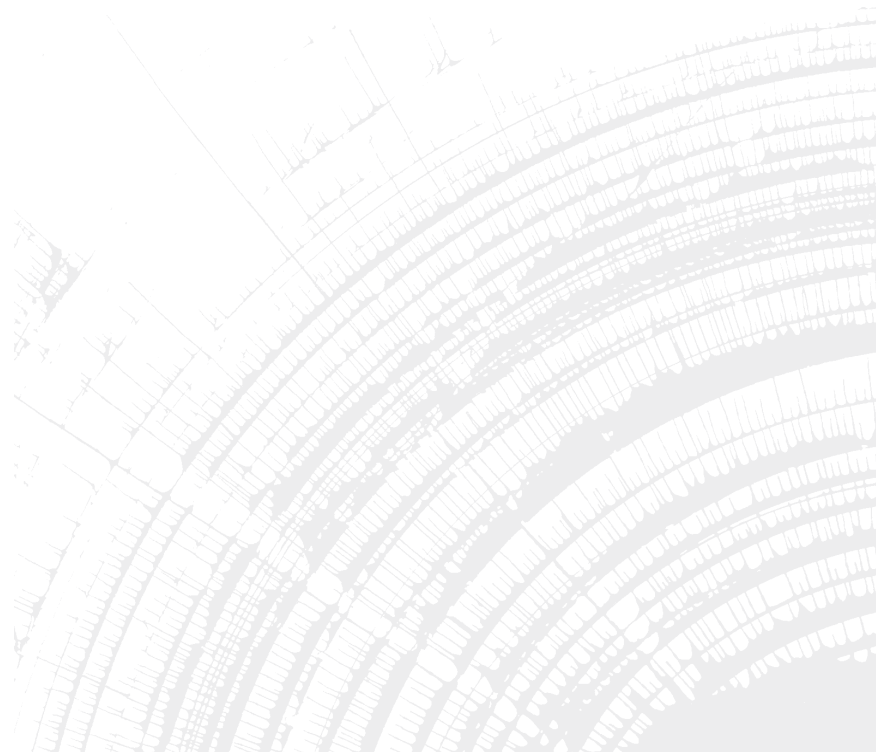
vom 01.01.2018 bis 30.06.2018  
Veritas Investment GmbH

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](http://www.veritas-investment.de)



# VERMÖGENSAUFSTELLUNG

## Zusammengefasste Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2018

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>			
<b>1. Aktien</b>			
- Deutschland	EUR	583.654,00	0,64
- Euro-Länder	EUR	2.763.677,33	3,01
- Sonstige EU/EWR-Länder	EUR	2.004.464,31	2,19
- Nicht EU/EWR-Länder	EUR	11.173.021,22	12,19
<b>2. Anleihen</b>			
- Pfandbriefe	EUR	12.743.998,00	13,90
- Unternehmensanleihen	EUR	19.025.673,18	20,75
<b>3. Investmentanteile</b>			
- Aktienfonds	EUR	5.080.300,16	5,54
- Indexfonds	EUR	3.805.813,04	4,15
<b>4. Derivate</b>			
- Futures (Verkauf)	EUR	64.800,00	0,07
- Futures (Kauf)	EUR	-59.342,51	-0,06
<b>5. Bankguthaben</b>			
- Bankguthaben in EUR	EUR	13.856.729,72	15,11
- Bankguthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	1.048.384,05	1,14
- Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR	1.902.654,15	2,08
- Tages-/Termingelder in EUR	EUR	17.014.402,24	18,56
<b>6. Sonstige Vermögensgegenstände</b>			
	EUR	901.577,16	0,98
<b>II. Verbindlichkeiten</b>			
1. Sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-224.374,38	-0,25
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>EUR</b>	<b>91.685.431,67</b>
			<b>100,00*)</b>

## 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	
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>								<b>EUR</b>	<b>47.871.768,57</b>	<b>52,22</b>
<b>Aktien</b>										
DE0008404005	Allianz SE		STK	1.100	1.600	500	EUR 177,0200	194.722,00	0,21	
DE0007164600	SAP SE		STK	2.000	2.000	0	EUR 98,7900	197.580,00	0,22	
DE0008303504	TAG Tegersee Immobilien-und Beteiligungs-AG		STK	10.200	19.000	8.800	EUR 18,7600	191.352,00	0,21	
CH0016440353	Ems-Chemie Holding AG		STK	397	570	173	CHF 635,0000	218.188,51	0,24	
CH0010645932	Givaudan AG		STK	100	100	0	CHF 2.251,0000	194.824,30	0,21	
CH0018294154	PSP Swiss Property AG		STK	2.400	2.400	0	CHF 91,3500	189.752,47	0,21	
CH0002497458	SGS SA		STK	86	140	54	CHF 2.620,0000	195.014,71	0,21	
CH0008742519	Swisscom AG		STK	500	30	280	CHF 442,6000	191.535,40	0,21	
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG		STK	750	750	0	CHF 295,1000	191.557,04	0,21	
ES0111845014	Abertis Infraestructuras S.A.		STK	6.406	6.406	0	EUR 18,3600	117.614,16	0,13	
FR0010220475	Alstom S.A.		STK	4.900	4.900	0	EUR 39,6200	194.138,00	0,21	
FR0000130403	Christian Dior SE		STK	530	530	0	EUR 358,8000	190.164,00	0,21	
FR0000124570	Compagnie Plastic Omnium S.A.		STK	5.200	7.600	2.400	EUR 36,4500	189.540,00	0,21	
FI0009007884	Elisa Oyj A		STK	2.556	2.556	8.600	EUR 39,4600	100.859,76	0,11	
IT0003132476	Eni S.p.A.		STK	12.400	12.400	0	EUR 16,0100	198.524,00	0,22	
FR0010040865	Gecina S.A.		STK	1.310	10	800	EUR 143,3000	187.723,00	0,20	
IE00BGHQ1986	Hibernia REIT PLC		STK	3.705	3.705	0	EUR 1,5000	5.557,50	0,01	
FI0009000202	Kesko Oyj B		STK	3.800	6.100	2.300	EUR 52,0200	197.676,00	0,22	
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V.		STK	2.300	0	1.400	EUR 86,2400	198.352,00	0,22	
FR0010307819	Legrand S.A.		STK	3.100	4.600	1.500	EUR 62,9800	195.238,00	0,21	
FR0000120321	L'Oréal S. A.		STK	920	920	0	EUR 209,6000	192.832,00	0,21	
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.		STK	1.400	1.400	0	EUR 140,5000	196.700,00	0,21	
FR0000120271	Total S.A.		STK	3.700	3.700	0	EUR 52,6000	194.620,00	0,21	
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V.		STK	4.000	4.000	0	EUR 48,1100	192.440,00	0,21	
GB00B02L3W35	Berkeley Group Holdings PLC Units		STK	4.478	7.000	2.522	GBP 37,5500	190.149,16	0,21	

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

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG

## 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
GB00BYZWX769	Croda International PLC		STK	4.673	5.700	1.027	GBP 48,0200	253.757,16	0,28
GB00BD8QVH41	Intercontinental Hotels Group PLC		STK	3.600	5.700	2.100	GBP 47,0400	191.500,62	0,21
GB00B2987V85	Rightmove PLC		STK	2.310	2.310	0	GBP 52,9400	138.291,76	0,15
GB00B03MM408	Royal Dutch Shell PLC B		STK	6.300	6.300	0	GBP 27,3800	195.062,76	0,21
GB00B5ZNI1N88	Segro PLC		STK	22.535	43.000	20.465	GBP 6,6240	168.802,26	0,18
GB00B2PDGW16	WH Smith PLC (New)		STK	10.179	13.000	2.821	GBP 20,2400	232.978,58	0,25
JP3114800000	Adeka Corp.		STK	10.400	200	0	JPY 1.777,0000	144.616,03	0,16
JP3429800000	ANA Holdings Inc.		STK	4.700	500	0	JPY 4.069,0000	149.651,54	0,16
JP3830800003	Bridgestone Corp.		STK	4.200	400	0	JPY 4.333,0000	142.407,75	0,16
JP3242800005	Canon Inc.		STK	4.900	400	0	JPY 3.631,0000	139.225,24	0,15
JP3305530002	COMSYS Holdings Corp.		STK	6.800	6.800	0	JPY 2.939,0000	156.388,26	0,17
JP3475200006	Daiichikosho Co. Ltd.		STK	3.400	0	300	JPY 5.350,0000	142.340,46	0,16
JP3486800000	Daito Trust Construction Co. Ltd.		STK	1.000	1.000	0	JPY 18.010,0000	140.931,92	0,15
JP3505000004	Daiwa House Industry Co. Ltd.		STK	4.800	200	0	JPY 3.776,0000	141.830,25	0,15
JP3768600003	Haseko Corp.		STK	11.800	11.800	0	JPY 1.531,0000	141.368,57	0,15
JP3143600009	Itochu Corp.		STK	9.000	9.000	0	JPY 2.007,5000	141.381,87	0,15
JP3705200008	Japan Airlines Co. Ltd.		STK	4.400	0	200	JPY 3.928,0000	135.244,56	0,15
JP3277150003	K's Holdings Corp.		STK	12.600	12.600	0	JPY 1.151,0000	113.485,80	0,12
JP3210200006	Kajima Corp.		STK	19.000	1.000	0	JPY 858,0000	127.566,47	0,14
JP3496400007	KDDI Corp.		STK	7.000	900	0	JPY 3.031,0000	166.027,35	0,18
JP3258000003	Kirin Holdings Co. Ltd.		STK	6.600	0	300	JPY 2.963,0000	153.028,12	0,17
JP3283750002	Kohnan Shoji Co. Ltd.		STK	7.500	7.500	0	JPY 2.579,0000	151.359,00	0,17
JP3269600007	Kuraray Co. Ltd.		STK	11.000	2.000	0	JPY 1.526,0000	131.353,87	0,14
JP3254200003	Kyowa Exeo Corp.		STK	7.100	0	400	JPY 2.909,0000	161.620,98	0,18
JP3167500002	Leopalace21 Corp.		STK	23.000	23.000	0	JPY 607,0000	109.247,67	0,12
JP3977200009	Lintec Corp.		STK	6.200	6.200	0	JPY 3.215,0000	155.979,79	0,17
JP3888300005	Mitsui Chemicals Inc.		STK	5.700	5.700	0	JPY 2.950,0000	131.580,80	0,14
JP3756200006	Nifco Inc.		STK	5.200	5.200	0	JPY 3.430,0000	139.570,33	0,15
JP3735400008	Nippon T & T Corp.		STK	3.800	300	0	JPY 5.036,0000	149.749,36	0,16
JP3753400005	NOF Corp.		STK	6.300	6.300	0	JPY 3.580,0000	176.489,64	0,19
JP3165650007	NTT DOCOMO INC		STK	7.000	100	0	JPY 2.822,5000	154.606,46	0,17
JP3781620004	Paramount Bed Holdings Co. Ltd.		STK	3.400	3.400	0	JPY 4.750,0000	126.377,04	0,14
JP3309000002	Penta-Ocean Constr. Co. Ltd.		STK	26.000	26.000	0	JPY 742,0000	150.963,83	0,16
JP3324500002	SAN-A Co. Ltd.		STK	3.100	3.100	0	JPY 5.470,0000	132.691,98	0,14
JP3420600003	Sekisui House Ltd.		STK	10.300	800	0	JPY 1.960,0000	157.975,21	0,17
JP3443600006	Taisei Corp.		STK	3.600	200	0	JPY 6.110,0000	172.123,18	0,19
SE0000379190	Castellum A.B.		STK	13.760	200	8.000	SEK 144,1000	189.994,97	0,21
SE0011166974	Fabege AB		STK	19.000	33.000	14.000	SEK 106,0800	193.128,69	0,21
SE0000170375	Hufvudstaden A.B. A		STK	986	986	0	SEK 127,7000	12.065,00	0,01
SE0000549412	Kungsleden A.B.		STK	6.681	6.681	0	SEK 61,1000	39.114,91	0,04
SE0000108847	Lundbergforetagen AB		STK	7.659	4.930	2.021	SEK 272,0000	199.618,44	0,22
US88579Y1010	3M Co.		STK	1.100	100	500	USD 195,9700	186.186,73	0,20
IE00B4BNMY34	Accenture PLC		STK	1.490	0	960	USD 164,5000	211.698,91	0,23
US0010551028	Aflac Inc.		STK	4.970	4.310	3.600	USD 43,2100	185.484,28	0,20
US0200021014	Allstate Corp.		STK	2.400	300	1.100	USD 91,3500	189.359,13	0,21
US11133T1034	Broadridge Financial Solutions Inc.		STK	2.100	3.300	1.200	USD 114,5300	207.732,77	0,23
US1924461023	Cognizant Technology Solutions Corp. A		STK	2.800	4.300	1.500	USD 79,0200	191.100,36	0,21
US2774321002	Eastman Chemical Co.		STK	2.200	3.400	1.200	USD 99,7000	189.445,50	0,21
US4385161066	Honeywell International Inc.		STK	2.400	2.400	0	USD 143,1300	296.693,73	0,32
US45167R1041	IDEX Corp.		STK	1.700	2.400	700	USD 135,5200	198.984,28	0,22
US4523081093	Illinois Tool Works Inc.		STK	1.600	2.100	500	USD 138,5600	191.480,39	0,21
US4581401001	Intel Corp.		STK	1.200	1.200	11.000	USD 49,2500	51.045,09	0,06
US4781601046	Johnson & Johnson		STK	1.773	300	900	USD 122,0000	186.825,01	0,20
US5398301094	Lockheed Martin Corp.		STK	730	0	480	USD 295,2400	186.150,63	0,20
US5717481023	Marsh & McLennan Companies, Inc.		STK	2.780	180	1.500	USD 81,0300	194.561,58	0,21
US5949181045	Microsoft Corp.		STK	2.400	3.900	1.500	USD 98,6300	204.449,82	0,22
US6200763075	Motorola Solutions Inc.		STK	2.000	2.000	0	USD 117,1100	202.297,46	0,22
US6668071029	Northrop Grumman Corp.		STK	730	1.050	320	USD 307,7200	194.019,35	0,21
US7433151039	Progressive Corp.		STK	3.800	3.800	6.800	USD 59,5300	195.382,62	0,21
US7551115071	Raytheon Co.		STK	1.100	1.700	600	USD 192,9200	183.289,00	0,20
US7757111049	Rollins Inc.		STK	4.600	7.000	2.400	USD 52,4700	208.466,06	0,23
US78409V1044	S&P Global Inc.		STK	1.200	1.800	600	USD 203,6900	211.114,18	0,23
US7841171033	SEI Investment Co.		STK	3.600	4.700	1.100	USD 62,7900	195.235,79	0,21
CH0102993182	TE Connectivity Ltd.		STK	2.440	3.400	960	USD 89,4500	188.510,97	0,21
US89417E1091	The Travelers Companies Inc.		STK	1.746	0	700	USD 122,4500	184.658,58	0,20
US8725401090	TJX Companies Inc.		STK	2.660	0	1.800	USD 95,3300	219.016,93	0,24
US92826C8394	VISA Inc. A		STK	1.800	2.900	1.100	USD 132,7400	206.367,25	0,23
US94106L1098	Waste Management Inc. [Del.]		STK	2.800	4.200	1.400	USD 80,7700	195.332,53	0,21
US98419M1009	Xylem Inc.		STK	3.300	4.600	1.300	USD 66,3300	189.055,97	0,21

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG

ISIN	Gattungs- bezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Wbg. in 1.000	Bestand 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
DE000A2AAX45	0,100% WL Bank PF 31.08.26		EUR	1.300	0	0	% 96,3540	1.252.602,00	1,37
DE000NLB85X6	0,250% NORD/LB ÖPF 28.10.26		EUR	1.000	0	0	% 97,0420	970.420,00	1,06
DE000BHYOMQ1	0,375% Berlin Hyp HPF 21.02.25		EUR	1.000	0	0	% 100,1300	1.001.300,00	1,09
DE000HSH5Y29	0,375% HSH Nordbank HPF 27.04.23		EUR	900	0	0	% 99,9770	899.793,00	0,98
DE000A2AAW53	0,500% DG HYP PF 30.09.26		EUR	1.000	0	0	% 99,3130	993.130,00	1,08
DE000MHB13J7	0,500% Münchener Hypothekenbank HPF 14.03.25		EUR	1.000	0	0	% 100,8840	1.008.840,00	1,10
DE000A14J5J4	0,500% WL BANK HPF 01.04.27		EUR	1.300	0	0	% 98,7990	1.284.387,00	1,40
DE000A12UGG2	1,125% WL BANK AG PF 18.09.24		EUR	1.000	0	0	% 105,1300	1.051.300,00	1,15
XS0828235225	1,750% Linde MTN 17.09.20		EUR	706	0	0	% 104,1500	735.299,00	0,80
DE000MHB06J1	1,750% Münchener Hypothekenbank HPF 03.06.22		EUR	2.000	0	0	% 107,0680	2.141.360,00	2,34
DE000A1R0XG3	2,000% BASF MTN 05.12.22		EUR	1.131	0	0	% 107,9470	1.220.880,57	1,33
XS0775280166	2,000% Helaba ÖPF 26.04.19		EUR	2.100	0	0	% 101,9460	2.140.866,00	2,34
XS1109802303	1,000% Vodafone Group MTN 11.09.20		EUR	1.000	0	0	% 101,9300	1.019.300,00	1,11
XS1139315581	1,375% Total Capital International MTN 19.03.25		EUR	400	0	0	% 104,1450	416.580,00	0,45
DE000A1G85B4	1,500% Siemens Financieringsmaatschappij MTN		EUR	706	0	0	% 102,8880	726.389,28	0,79
XS0878010718	1,875% Innogy Finance MTN 30.01.20		EUR	530	0	0	% 102,8760	545.242,80	0,59
XS1176079843	1,966% ENEL Finance International MTN 27.01.25		EUR	700	0	0	% 103,1430	722.001,00	0,79
XS0875796541	2,125% Deutsche Telekom Internation. Finance MTN		EUR	883	0	0	% 105,2000	928.916,00	1,01
XS0811554962	2,125% Heineken MTN 04.08.20		EUR	706	0	0	% 104,5400	738.052,40	0,80
XS0825855751	2,250% Fortum MTN 06.09.22		EUR	706	0	0	% 106,9680	755.194,08	0,82
FR0011372622	2,375% Auchan Holding MTN 12.12.22		EUR	500	0	0	% 107,9730	539.865,00	0,59
FR0011318658	2,750% E.D.F. MTN 10.03.23		EUR	800	0	0	% 110,2820	882.256,00	0,96
XS0747744232	2,994% BP Capital Markets MTN 18.02.19		EUR	883	0	0	% 102,0440	901.048,52	0,98
XS0729046218	3,250% BMW Finance MTN 14.01.19		EUR	883	0	0	% 101,8750	899.556,25	0,98
IT0004869985	3,625% Atlantia OBL 30.11.18		EUR	706	0	0	% 101,5300	716.801,80	0,78
FR0010957662	3,641% Bouygues Bds. 29.10.19		EUR	750	0	0	% 104,7860	785.895,00	0,86
XS0543354236	3,750% Koninklijke KPN MTN 21.09.20		EUR	706	0	0	% 108,3310	764.816,86	0,83
FR0011182641	3,875% E.D.F. MTN 18.01.22		EUR	1.200	0	0	% 112,9730	1.355.676,00	1,48
XS0563306314	3,875% Orange EMTN 14.01.21		EUR	850	0	0	% 109,6890	932.356,50	1,02
XS0874864860	3,987% Telefonica Emisiones MTN 23.01.23		EUR	1.100	0	0	% 114,9140	1.264.054,00	1,38
XS0741137029	4,250% ENI MTN 03.02.20		EUR	706	0	0	% 106,6020	752.610,12	0,82
XS0767977811	4,250% Iberdrola International MTN 11.10.18		EUR	900	0	0	% 101,2480	911.232,00	0,99
FR0011400571	4,561% Casino, Guichard-Perrachon MTN 25.01.23		EUR	500	0	0	% 102,3300	511.650,00	0,56
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>422.719,47</b>	<b>0,46</b>
<b>Aktien</b>									
US74144T1088	T. Rowe Price Group Inc.		STK	1.970	0	2.150	USD 115,6800	196.829,85	0,21
US92343E1029	Verisign Inc.		STK	1.900	2.900	1.000	USD 137,6500	225.889,62	0,25
<b>Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>8.886.113,20</b>	<b>9,69</b>
<b>Gruppenfremde Wertpapier-Investmentanteile</b>									
LU1239760454	DB Platinum IV - Dividend Equity Risk Control		ANT	46.084	0	2.505	EUR 110,2400	5.080.300,16	5,54
IE00B66F4759	iShares - Euro High Yield Corporate Bond ETF		ANT	36.679	0	0	EUR 103,7600	3.805.813,04	4,15
<b>Summe Wertpapiervermögen **)</b>							<b>EUR</b>	<b>57.180.601,24</b>	<b>62,37</b>

\*\*) 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 30.06.2018	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>							EUR	-3.935,57	0,00
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>									
	E-Mini S&P 500 Index Future 09/18	NAR	USD	Anzahl	950			-56.410,87	-0,06
	EURO STOXX 50 Index Future 09/18	EDT	EUR	Anzahl	-1.200			64.800,00	0,07
	Nikkei 225 Yen-Denominated Index Future CME 09/18	NAR	JPY	Anzahl	7.000			-12.324,70	-0,01
<b>Zins-Derivate</b>							EUR	9.393,06	0,01
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>									
<b>Zinsterminkontrakte</b>									
	6,000% 5-Year U.S. Treasury Notes Future 09/18	NAU	USD		2.900.000			9.393,06	0,01
<b>Bankguthaben</b>							EUR	33.822.170,16	36,89
EUR-Guthaben bei:									
	Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)			EUR	13.856.729,72		% 100,0000	13.856.729,72	15,11
	Guthaben Tagesgeld (bei anderen Kreditinstituten)			EUR	17.014.402,24		% 100,0000	17.014.402,24	18,56
	Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)			DKK	34.848,77		% 100,0000	4.677,00	0,01
				GBP	156.760,09		% 100,0000	177.270,26	0,19
				NOK	2.468.090,82		% 100,0000	260.237,33	0,28
				SEK	6.326.388,55		% 100,0000	606.199,46	0,66
	Guthaben in Nicht EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)			AUD	1.329,72		% 100,0000	843,76	0,00
				CAD	12.731,79		% 100,0000	8.291,08	0,01
				CHF	428.489,95		% 100,0000	370.858,53	0,40
				HKD	5.125,11		% 100,0000	564,03	0,00
				JPY	135.646.699,00		% 100,0000	1.061.463,05	1,17
				SGD	2.139,27		% 100,0000	1.351,19	0,00
				USD	531.757,29		% 100,0000	459.282,51	0,50
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							EUR	901.577,16	0,98
	Dividendenansprüche			EUR	32.654,13			32.654,13	0,04
	Einschüsse (Initial Margin)			EUR	453.722,93			453.722,93	0,49
	Quellensteueransprüche			EUR	111.123,52			111.123,52	0,12
	Zinsansprüche			EUR	304.076,58			304.076,58	0,33
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							EUR	-224.374,38	-0,25
	Kostenabgrenzung			EUR	-128.162,95			-128.162,95	-0,14
	Sonstiger Aufwand Geldmarktprodukte			EUR	-6.323,69			-6.323,69	-0,01
	Variation Margin			EUR	-72.657,38			-72.657,38	-0,08
	Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften			EUR	-17.230,36			-17.230,36	-0,02
<b>Fondsvermögen</b>							EUR	91.685.431,67	100,00 *)
<b>Anteilwert Veri Multi Asset Allocation ( R )</b>							EUR	138,81	
<b>Anteilwert Veri Multi Asset Allocation ( I )</b>							EUR	1.097,46	
<b>Anteilwert Veri Multi Asset Allocation ( W )</b>							EUR	95,83	
<b>Anteilwert Veri Multi Asset Allocation ( A )</b>							EUR	978,61	
<b>Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation ( R )</b>							STK	650.026	
<b>Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation ( I )</b>							STK	1.300	
<b>Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation ( W )</b>							STK	200	
<b>Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation ( A )</b>							STK	10	

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

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 29.06.2018
Australische Dollar	(AUD)	1,575950 = 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,884300 = 1 Euro (EUR)
Dänische Kronen	(DKK)	7,451100 = 1 Euro (EUR)
Hongkong Dollar	(HKD)	9,086650 = 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	127,792200 = 1 Euro (EUR)
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,535600 = 1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	(NOK)	9,484000 = 1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	10,436150 = 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	1,155400 = 1 Euro (EUR)
Singapur-Dollar	(SGD)	1,583250 = 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,157800 = 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

b) Terminbörse

EDT  
NAR  
NAU

EUREX Terminbörse Deutschland  
Chicago Mercantile Exchange  
Chicago Board of Trade

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte,  
soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen  
(Marktzuzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungs- bezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
DE0005158703	Bechtle AG	STK	4.300	4.300
DE000A0HN5C6	Deutsche Wohnen SE	STK	0	8.000
US0220951033	Altria Group Inc.	STK	0	4.030
JP3942400007	Astellas Pharma Inc.	STK	0	13.500
US00206R1023	AT & T Inc.	STK	0	9.110
SE0006993770	Axfood AB	STK	20.300	20.300
CH0009002962	Barry Callebaut AG	STK	180	180
GB00BYQ0JC66	Beazley PLC	STK	0	53.500
FR0000120966	BIC S.A.	STK	0	3.100
BE0974268972	bpost S.A.	STK	0	11.500
US12673P1057	CA Inc.	STK	0	10.540
CH0044328745	Chubb Ltd.	STK	0	2.200
FR0000121261	Cie Generale ETS Michelin SCpA	STK	0	2.410
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	STK	0	9.940
JP3352400000	Citizen Watch Co. Ltd.	STK	0	23.600
US1941621039	Colgate-Palmolive Co.	STK	0	4.250
US1266501006	CVS Health Corp.	STK	0	4.100
US2371941053	Darden Restaurants Inc.	STK	0	5.050
DK0060655629	DFDS A.S.	STK	0	6.600
ES0112501012	Ebro Puleva S.A.	STK	14.400	14.400
BE0974256852	Établissements Fr. Colruyt SA	STK	0	6.620
NL0006294274	Euronext N.V.	STK	5.000	5.000
SE0000950636	Fabege A.B.	STK	0	16.900
PTGALOAM0009	Galp Energia, SGPS, S.A.	STK	19.500	19.500
US3724601055	Genuine Parts Co.	STK	0	3.540
SE0000106270	H & M Hennes & Mauritz A.B. B	STK	0	14.900
US4404521001	Hormel Foods Corp.	STK	0	9.600
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.	STK	0	44.600
SE0000107419	Investor A.B. B	STK	0	7.550
JP3385980002	JSR Corp.	STK	0	9.200
US4878361082	Kellogg Co.	STK	0	5.200
US4943681035	Kimberly-Clark Corp.	STK	0	2.500
FI0009013403	Kone Corp. New B	STK	0	6.747
NO0003096208	Leroy Seafood Group	STK	0	65.900
JP3861600009	Maeda Road Construction Co. Ltd.	STK	0	7.000

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG

ISIN	Gattungs- bezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
NO0003054108	Marine Harvest ASA	STK	0	20.200
JP3871200006	Maruichi Steel Tube Ltd.	STK	0	5.900
US5801351017	McDonald's Corp.	STK	0	2.200
ES0152503035	Mediaset Espana Comunicacion S.A.	STK	0	30.330
JP3919200000	Meitec Corp.	STK	0	3.500
SE0000117970	NCC A.B. B	STK	0	16.800
JP3660400007	Nichias Corp.	STK	0	14.000
JP3694400007	Nippon Kayaku Co. Ltd.	STK	0	11.700
JP3659200004	Nishimatsu Construction Co. Ltd.	STK	0	6.200
JP3190000004	Obayashi Corp.	STK	0	14.300
NO0003733800	Orkla A.S.	STK	33.000	33.000
AT0000APOST4	Österreichische Post AG	STK	7.600	7.600
CH0024608827	Partners Group Holding AG	STK	500	500
US7181721090	Philip Morris International Inc.	STK	0	2.923
BE0003810273	Proximus S.A.	STK	0	10.250
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A.	STK	0	17.650
GB00B082RF11	Rentokil Initial PLC	STK	0	83.300
FR0000073272	Safran S.A.	STK	3.400	3.400
FI0009003305	Sampo PLC A	STK	0	6.600
JP3421800008	Secom Co. Ltd.	STK	0	2.300
JP3358800005	Shimizu Corp.	STK	0	15.800
GB0007908733	SSE PLC	STK	0	19.580
JP3404200002	Sumitomo Rubber Industries Ltd.	STK	0	9.800
FR0000121329	Thales S.A.	STK	0	3.500
PTPT10AM0006	The Navigator Company S.A.	STK	64.400	64.400
JP3590900001	Token Corp.	STK	0	1.300
US8910271043	Torchmark Corp.	STK	0	4.450
FR0000124711	Unibail-Rodamco SE	STK	0	1.350
US92343V1044	Verizon Communications Inc.	STK	0	6.992
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
DE000CZ40JR9	1,000% Commerzbank ÖPF 25.06.18	EUR	0	1.000
FR0011437367	1,250% Danone MTN 06.06.18	EUR	0	700
XS0760139773	2,000% Roche Finance Europe MTN 25.06.18	EUR	0	706
FR0011261916	2,250% Engie MTN 01.06.18	EUR	0	706
XS0829183614	3,875% Snam MTN 19.03.18	EUR	0	1.059
<b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>				
CH0012032048	Roche Holding AG GEN	STK	0	1.410
<b>Andere Wertpapiere</b>				
ES06445809F4	Iberdrola S.A. ANR	STK	44.600	44.600
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
US3021301094	Expeditors International of Washington Inc.	STK	0	5.500

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG

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	Volumen in 1.000
<b>Terminkontrakte</b>				
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>				
Gekaufte Kontrakte:				
(Basiswerte: E-Mini S&P 500 Index Future, EURO STOXX 50 Index Future, Nikkei 225 Index Futures (USD) CME, Nikkei 225 Yen-Denominated Index Future CME)				
	EUR			19.074
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte: EURO STOXX 50 Index Future Nikkei 225 Yen-Denominated Index Future CME)				
	EUR			19.697
<b>Zinsterminkontrakte</b>				
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte: Euro Bobl Future)				
	EUR			6.532



# SONSTIGE ANGABEN

## Sondervermögen Veri Multi Asset Allocation

Anteilklassen-Bezeichnung	( R )	( I )
Mindestanlagesumme	keine	1.000.000,00 EUR
Fondsauflage	03.08.1970	19.02.2014
Ausgabeaufschlag	5,00%	0,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	1,40%	0,70%
Erfolgsbezogene Zusatzvergütung	10% des eine Wertentwicklung von 4% p.a. übersteigenden Betrages (High Watermark)	10% des eine Wertentwicklung von 4% p.a. übersteigenden Betrages (High Watermark)
Kostenpauschale p.a.	0,3%	0,3%
Stückelung	Globalurkunde	Globalurkunde
Ertragsverwendung	ausschüttend	ausschüttend
Währung	EUR	EUR
ISIN	DE0009763235	DE000A0MKQQ4

Anteilklassen-Bezeichnung	( W )	( A )
Mindestanlagesumme	keine	1.000.000,00
Fondsauflage	18.03.2015	01.07.2015
Ausgabeaufschlag	5,00%	0,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	1,40%	0,70%
Erfolgsbezogene Zusatzvergütung	keine	10% des eine Wertentwicklung von 4% p.a. übersteigenden Betrages (High Watermark)
Kostenpauschale p.a.	0,3%	0,3%
Stückelung	Globalurkunde	Globalurkunde
Ertragsverwendung	ausschüttend	ausschüttend
Währung	EUR	EUR
ISIN	DE000A1W2AF2	DE000A114514

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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

Anteilwert Veri Multi Asset Allocation ( R )	EUR	138,81
Anteilwert Veri Multi Asset Allocation ( I )	EUR	1.097,46
Anteilwert Veri Multi Asset Allocation ( W )	EUR	95,83
Anteilwert Veri Multi Asset Allocation ( A )	EUR	978,61
Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation ( R )	STK	650,026
Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation ( I )	STK	1.300
Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation ( W )	STK	200
Umlaufende Anteile Veri Multi Asset Allocation ( A )	STK	10

# SONSTIGE ANGABEN

---

## 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  
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](mailto:info@veritas-investment.de)  
Internet: [www.veritas-investment.de](http://www.veritas-investment.de)

