



# Halbjahresbericht

zum 31. Mai 2017

**amandea**

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



**HAUCK & AUFHÄUSER**  
INVESTMENT GESELLSCHAFT S.A.

Verwaltungsgesellschaft



**HAUCK & AUFHÄUSER**  
PRIVATBANKIERS SEIT 1796

Verwahrstelle

Halbjahresbericht 2017

## Inhalt

Management und Verwaltung	3
Erläuterungen zu der Vermögensübersicht	5
amandea - ALTRUID HYBRID	6



# Management und Verwaltung

## Verwaltungsgesellschaft

**Hauck & Aufhäuser Investment Gesellschaft S.A.**  
R.C.S. Luxembourg B 31.093  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach  
Eigenkapital zum 31. Dezember 2016: EUR 2.700.000

## Aufsichtsrat

### Vorsitzender

**Michael Bentlage**  
Persönlich haftender Gesellschafter  
Sprecher der Geschäftsleitung  
Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Frankfurt am Main

### Mitglieder

**Jochen Lucht (bis zum 16. Februar 2017)**  
Persönlich haftender Gesellschafter  
Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Frankfurt am Main

**Marie-Anne van den Berg**  
Niederlassungsleiterin (bis 31. Dezember 2016)  
Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung  
Luxemburg  
Independent Director (seit dem 1. Januar 2017)

**Andreas Neugebauer (seit dem 16. Februar 2017)**  
Independent Director

## Vorstand

**Stefan Schneider**  
Hauck & Aufhäuser Investment Gesellschaft S.A., Luxemburg

**Achim Welschhoff**  
Hauck & Aufhäuser Investment Gesellschaft S.A., Luxemburg

## Verwahrstelle

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

## Zahl-, Vertriebs- und Informationsstellen

### *Großherzogtum Luxemburg*

**Hauck & Aufhäuser Privatbankiers KGaA, 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

**Vertriebsstelle Deutschland:  
amandea Vermögensverwaltung AG**  
Waldstraße 2, D-91616 Neusitz

### *Republik Österreich*

**Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG**  
Am Belvedere 1, A-1100 Wien

## Fondsmanager

**amandea Vermögensverwaltung AG**  
Waldstraße 2, D-91616 Neusitz

## Co-Fondsmanager

**Altruid Systems Limited**  
26, St. Thomas Street, FRN 1124 Southern Harbour Floriana

## Abschlussprüfer

**PricewaterhouseCoopers, Société coopérative**  
Cabinet de révision agréé  
2, rue Gerhard Mercator, L-1014 Luxemburg

## Register- und Transferstelle

**Hauck & Aufhäuser Investment Gesellschaft S.A.**  
1c, rue Gabriel Lippmann, L-5365 Munsbach



**Sehr geehrte Damen und Herren,**

der vorliegende Bericht informiert Sie umfassend über die Entwicklung des Investmentfonds amandea mit seinem Teilfonds amandea - ALTRUID HYBRID.

Der Investmentfonds ist ein nach Luxemburger Recht in Form eines fonds commun de placement (FCP) 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") gegründet und erfüllt die Anforderungen der 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 Anteilhaber im Internet unter [www.hauck-aufhaeuser.com](http://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. Dezember 2016 bis zum 31. Mai 2017.

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

amandea - ALTRUID HYBRID A	10,93 %
amandea - ALTRUID HYBRID B	10,98 %
amandea - ALTRUID HYBRID C	12,09 %

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 31. Mai 2017

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.



# Vermögensübersicht

## Vermögensaufstellung zum 31.05.2017

### amandea - ALTRUID HYBRID

Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.05.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Wertpapiervermögen</b>								<b>5.587.607,50</b>	<b>41,73</b>	
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>										
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>										
<b>Bundesrep. Deutschland</b>										
Baden-Württemberg, Land - Schatzanweisung - 4,250 04.01.2018		DE0001040509	Nominal	1.000.000,00	0,00	0,00	EUR	103,00	1.030.010,00	7,69
Bundesrep.Deutschland - Anleihe - 1,000 12.10.2018		DE0001141679	Nominal	1.000.000,00	0,00	0,00	EUR	102,45	1.024.490,00	7,65
Bundesrep.Deutschland - Anleihe - 4,250 04.07.2017		DE0001135333	Nominal	1.000.000,00	0,00	0,00	EUR	100,45	1.004.510,00	7,50
Nordrhein-Westfalen, Land - Schatzanweisung - 0,875 04.12.2017		DE000NRW21B0	Nominal	1.000.000,00	0,00	0,00	EUR	100,72	1.007.215,00	7,52
Sachsen-Anhalt, Land - Schatzanweisung - 4,500 11.09.2017		DE000A0S8XM4	Nominal	1.500.000,00	0,00	0,00	EUR	101,43	1.521.382,50	11,36
<b>Derivate</b>								<b>527.356,49</b>	<b>3,94</b>	
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>										
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten</b>										
3Y Australia Treasury Bond (SFE) Jun.2017	XSFE			7,00			AUD		2.105,01	0,02
10Y Australia Treasury Bond (SFE) Jun.2017	XSFE			2,00			AUD		1.659,40	0,01
Euro BOBL Future (EURX) Jun.2017	XEUR			12,00			EUR		6.140,00	0,05
Euro Bund Future (EURX) Jun.2017	XEUR			9,00			EUR		6.430,00	0,05
Euro BUXL Future (EURX) Jun.2017	XEUR			-1,00			EUR		-3.200,00	-0,02
10Y Canadian Govt. Bond Future (ME) Sep.2017	XMOD			16,00			CAD		10.416,24	0,08
Long Term Euro OAT Futures (EURX) Jun.2017	XEUR			9,00			EUR		14.060,00	0,11
10Y Long Gilt Future (ICE) Sep.2017	IFUS			8,00			GBP		3.774,14	0,03
ITALIEN,REP.GOV.BD. (EURX) Jun.2017	XEUR			3,00			EUR		-1.710,00	-0,01
Short term Euro-B.T.P. Future (EURX) Jun.2017	XEUR			37,00			EUR		24.640,00	0,18
Tokyo (Japan) 10Y Gvt.Bd. (OSE) Jun.2017	XMOD			2,00			JPY		-3.466,72	-0,03
Swiss Fed. Bond Future (EURX_CHF) Jun.2017	XEUR			-2,00			CHF		-3.954,05	-0,03
10Y.KOREA GOV.BD.SYN.AN. (KOFX) Jun.2017	XKRX			-6,00			KRW		-230,61	0,00
US Treasury Long Bonds Future (CBT) Sep.2017	XCBT			-1,00			USD		-587,09	0,00
10Y Treasury Notes Future (CBT) Sep.2017	XCBT			5,00			USD		1.048,37	0,01
5Y Treasury Notes Future (CBT) Sep.2017	XCBT			8,00			USD		950,53	0,01
<b>Derivate auf Index-Derivate</b>										
<b>Optionsrechte auf Aktienindices und Aktienindex-Terminkontrakte</b>										
CBOE Volatility Index (CBOE) CALL 30 Jun.2017	SMEX			18.000,00			USD		1.011,27	0,01
CBOE Volatility Index (CBOE) CALL 30 Jul.2017	SMEX			18.000,00			USD		2.684,38	0,02



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.05.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Aktienindices</b>										
SPI 200 Index Future (SFE) Jun.2017	XSFE			8,00			AUD		-2.134,90	-0,02
DAX Performance Index Future (EURX) Jun.2017	XEUR			2,00			EUR		27.625,00	0,21
Euro Stoxx 50 Future (EURX) Jun.2017	XEUR			20,00			EUR		38.260,00	0,29
S&P Canada 60 Index Future (ME) Jun.2017	XMOD			2,00			CAD		-1.806,90	-0,01
CAC40 Future (MONP) Jun.2017	XMAT			14,00			EUR		-7.000,00	-0,05
FTSE 100 Index Future (ICE) Jun.2017	IFUS			8,00			GBP		19.215,90	0,14
Hang Seng Index Future (HKFE) Jun.2017	XSES			4,00			HKD		7.989,63	0,06
Hang Seng China Enterpr.Future (HKFE) Jun.2017	XSES			8,00			HKD		12.581,37	0,09
FTSE/MIB Index (IDEM) Jun.2017	TRQX			4,00			EUR		16.545,00	0,12
Topix Index Future (OSE) Jun.2017	XMOD			4,00			JPY		564,35	0,00
Nikkei 225 Stock Avg.Ind.Fut. (OSE) Jun.2017	XMOD			3,00			JPY		-7.417,16	-0,06
Amsterdam (AEX) Index Futures (AEX) Jun.2017	XAMS			8,00			EUR		-9.760,00	-0,07
OBX Index Futures (OSSE) Jun.2017	XOSC			96,00			NOK		-8.063,98	-0,06
WIG20 Index Futues (EWW) Jun.2017	XWAR			42,00			PLN		11.177,43	0,08
OMX Stockholm 30 Index (OMS) Jun.2017	XSTO			46,00			SEK		-1.577,29	-0,01
SMI Index Future (EURX_CHF) Jun.2017	XEUR			8,00			CHF		28.091,15	0,21
FTSE China A50 Index Futures (SGX_USD) Jun.2017	XSIM			75,00			USD		18.115,94	0,14
SGX S&P CNX NIFTY Index Future (SGX_USD) Jun.2017	XSIM			47,00			USD		19.005,19	0,14
MSCI Taiwan Index Future (SGX_USD) Jun.2017	XSIM			22,00			USD		787,26	0,01
MSCI Singapore Index Future (SGX) Jun.2017	XSIM			31,00			SGD		-7.107,70	-0,05
IBEX 35 Index Future (MEFF) Jun.2017	XMRV			4,00			EUR		-1.972,00	-0,01
FTSE/JSE Top 40 Index Fut. (SAFX) Jun.2017	XSAF			17,00			ZAR		4.664,55	0,03
KOSPI 200 Index Future (KSE) Jun.2017	XKRX			11,00			KRW		65.513,84	0,49
E-MINI MSCI Em.Marktes Ind.Fut (NYB) Jun.2017	XNYM			12,00			USD		45.321,17	0,34
E-Mini Nasdaq 100 Index Future (CME) Jun.2017	XCME			8,00			USD		60.254,07	0,45
E-Mini S&P 500 Index Future (CME) Jun.2017	XCME			8,00			USD		17.015,56	0,13
MINI MSCI EAFE Index Fut. (NYB) Jun.2017	XNYM			9,00			USD		58.132,04	0,43
Russell 2000 Mini Index (ICE) (NYB) Jun.2017	XNYM			8,00			USD		-4.535,70	-0,03
CBOE Volatility Index Vix Fut. (CFX) Jul.2017	XCBF			-2,00			USD		10.690,64	0,08
CBOE Volatility Index Vix Fut. (CFX) Aug.2017	XCBF			-3,00			USD		11.473,43	0,09
CBOE Volatility Index Vix Fut. (CFX) Sep.2017	XCBF			-3,00			USD		10.131,51	0,08
Mini-Sized DJIA Index Futures (CBT) Jun.2017	XCBT			10,00			USD		6.942,20	0,05
S&P Midcap 400 E-Mini Index (CME) Jun.2017	XCME			4,00			USD		6.638,04	0,05
CBOE Volatility Index Vix Fut. (CFX) Okt.2017	XCBF			-3,00			USD		7.984,43	0,06
CBOE Volatility Index Vix Fut. (CFX) Nov.2017	XCBF			-3,00			USD		5.568,98	0,04
CBOE Volatility Index Vix Fut. (CFX) Dez.2017	XCBF			-3,00			USD		2.348,37	0,02
CBOE Volatility Index Vix Fut. (CFX) Jan.2018	XCBF			-3,00			USD		-939,35	-0,01
CBOE Volatility Index Vix Fut. (CFX) Feb.2018	XCBF			-3,00			USD		603,86	0,00



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.05.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Zins-Derivate</b>										
<b>Zinsterminkontrakte</b>										
Bank Bills (1.000.000) Future (SFE) Jun.2018	XSFE			9,00			AUD		3.557,47	0,03
3 Monat CAD Bank Accept (ME) Jun.2018	XMOD			9,00			CAD		-431,79	0,00
3M Euribor Int. Rate Future (ICE_EUR) Jun.2018	IFUS			1,00			EUR		0,00	0,00
Short Stl. 3-Mth.Int.Rate Fut. (ICE) Jun.2018	IFUS			10,00			GBP		1.308,87	0,01
3 Monat Eurodollar Future (CME) Jun.2018	XCME			-1,00			USD		-503,22	0,00
<b>Sonstige Derivate</b>										
<b>Terminkontrakte auf Sonstiges</b>										
RUB-USD Currency Futures (CME) Jun.2017	XCME			16,00			USD		33.134,28	0,25
British Pound (62.500) Future (CME) Jun.2017	XCME			1,00	-6,00	7,00	USD		-145,38	0,00
EUR-JPY Currency Future (CME_JPY) Jun.2017	XCME			7,00	7,00	0,00	JPY		-282,17	0,00
EUR-GBP Currency Future (CME_GBP) Jun.2017	XCME			3,00	8,00	-5,00	GBP		-129,45	0,00
MXN Currency Future (CME) Jun.2017	XCME			19,00			USD		5.443,73	0,04
CAD Currency Future (CME) Jun.2017	XCME			-14,00			USD		1.927,90	0,01
EUR-CHF Currency Future (CME_CHF) Jun.2017	XCME			12,00	-6,00	18,00	CHF		-8.944,76	-0,07
US Dollar Index Futures (NYB) Jun.2017	XNYM			-13,00			USD		3.139,20	0,02
JPY Currency Future (CME) Jun.2017	XCME			-8,00	-11,00	3,00	USD		-22.907,73	-0,17
CHF Currency Future (CME) Jun.2017	XCME			1,00			USD		201,29	0,00
AUD Currency Future (CME) Jun.2017	XCME			-13,00			USD		1.547,68	0,01
NZD Currency Future (CME) Jun.2017	XCME			-12,00	-9,00	-3,00	USD		-12.256,22	-0,09
<b>Bankguthaben</b>									<b>6.375.213,56</b>	<b>47,61</b>
<b>EUR - Guthaben</b>										
EUR bei LBBW Luxemburg S.A.				2.000.000,00			EUR		2.000.000,00	14,94
EUR bei UniCredit Luxembourg S.A.				2.000.000,00			EUR		2.000.000,00	14,94
EUR bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				768.592,93			EUR		768.592,93	5,74
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>										
GBP bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				110.469,58			GBP		127.112,11	0,95
NOK bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				537.336,79			NOK		56.918,30	0,43
PLN bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				566.733,94			PLN		135.648,97	1,01
SEK bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				798.071,27			SEK		81.686,68	0,61
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
AUD bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				102.325,84			AUD		68.267,56	0,51
CAD bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG,				192.473,09			CAD		127.860,13	0,95





Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.05.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Niederlassung Luxemburg CHF bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				56.144,14			CHF		51.507,30	0,38
Niederlassung Luxemburg HKD bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				1.227.389,51			HKD		140.896,33	1,05
Niederlassung Luxemburg JPY bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				-1.350.536,00			JPY		-10.888,20	-0,08
Niederlassung Luxemburg KRW bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				308.425.805,93			KRW		245.257,59	1,83
Niederlassung Luxemburg SGD bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				62.869,52			SGD		40.604,96	0,30
Niederlassung Luxemburg TRY bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				74.528,87			TRY		18.774,44	0,14
Niederlassung Luxemburg USD bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				581.426,35			USD		520.152,40	3,88
Niederlassung Luxemburg ZAR bei Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg				41.400,29			ZAR		2.822,06	0,02
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									<b>1.566.808,69</b>	<b>11,70</b>
Einschüsse (Initial Margin)				1.425.961,68			EUR		1.425.961,68	10,65
Zinsansprüche aus Bankguthaben				225,82			EUR		225,82	0,00
Zinsansprüche aus Wertpapieren				115.174,66			EUR		115.174,66	0,86
Sonstige Forderungen				1.504,11			EUR		1.504,11	0,01
Forderungen aus Future Variation Margin				11.469,99			EUR		23.942,42	0,18
<b>Gesamtaktiva</b>									<b>14.056.986,24</b>	<b>104,98</b>



Gattungsbezeichnung	Markt	ISIN	Stück/ Anteile/ Whg.	Bestand zum 31.05.2017	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Whg.	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
<b>Verbindlichkeiten</b>									<b>-666.843,56</b>	<b>-4,98</b>
<b>aus</b>										
Fondsmanagementvergütung				-19.699,56			EUR		-19.699,56	-0,15
Future Variation Margin				-557.212,21			EUR		-557.212,21	-4,16
Performance Fee				-68.091,48			EUR		-68.091,48	-0,51
Prüfungskosten				-9.869,39			EUR		-9.869,39	-0,07
Risikomanagementvergütung				-400,00			EUR		-400,00	0,00
Taxe d'abonnement				-1.115,12			EUR		-1.115,12	-0,01
Transfer- und Registerstellenvergütung				-1.050,00			EUR		-1.050,00	-0,01
Vertriebsstellenvergütung				-3.558,15			EUR		-3.558,15	-0,03
Verwahrstellenvergütung				-1.233,48			EUR		-1.233,48	-0,01
Verwaltungsvergütung				-3.511,96			EUR		-3.511,96	-0,03
Zinsverbindlichkeiten aus Bankguthaben				-1.102,21			ZAR		-1.102,21	-0,01
<b>Gesamtpassiva</b>									<b>-666.843,56</b>	<b>-4,98</b>
<b>Fondsvermögen</b>									<b>13.390.142,68</b>	<b>100,00*</b>

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



## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens, welche nicht in Fondswährung ausgedrückt sind, sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Devisenkurse bewertet.

## Devisenkurse (in Mengennotiz)

			per 30.05.2017
Australische Dollar	AUD	1,4989	= 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	GBP	0,8691	= 1 Euro (EUR)
Kanadische Dollar	CAD	1,5053	= 1 Euro (EUR)
Hongkong Dollar	HKD	8,7113	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	JPY	124,0367	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Kronen	NOK	9,4405	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	SEK	9,7699	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	1,0900	= 1 Euro (EUR)
Singapur-Dollar	SGD	1,5483	= 1 Euro (EUR)
Südafr.Rand	ZAR	14,6702	= 1 Euro (EUR)
Südkoreanische Won	KRW	1.257,5586	= 1 Euro (EUR)
Türkische Lira	TRY	3,9697	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,1178	= 1 Euro (EUR)
Zloty	PLN	4,1779	= 1 Euro (EUR)

## Marktschlüssel

### Terminhandel

IFUS	ICE Futures U.S.
SMEX	Singapore Mercantile Exchange Pte Ltd
TRQX	Turquoise
XAMS	Euronext - Euronext Amsterdam
XCBF	CBOE Futures Exchange
XCBT	Chicago Board Of Trade
XCME	Chicago Mercantile Exchange
XEUR	Eurex Deutschland
XKRX	Korea Exchange (Stock Market)
XMAT	Euronext Paris MATIF
XMOD	The Montreal Exchange / Bourse De Montreal
XMRV	Meff Financial Derivatives
XNYM	New York Mercantile Exchange
XOSC	OSLO CONNECT
XSAF	JSE Equity Derivatives Market
XSES	Singapore Exchange
XSFE	ASX - Trade24
XSIM	SINGAPORE EXCHANGE DERIVATIVES CLEARING LIMITED
XSTO	Nasdaq Stockholm AB
XWAR	Warsaw Stock Exchange



Fondsvermögen in EUR, Inventarwert je Anteil in EUR und umlaufende Anteile  
amandea - ALTRUID HYBRID

	<b>Anteilklasse A in EUR</b>	<b>Anteilklasse B in EUR</b>	<b>Anteilklasse C in EUR</b>
<b>zum 31.05.2017</b>			
Fondsvermögen	7.892.469,20	4.321.058,20	1.176.615,28
Inventarwert je Anteil	132,44	136,00	147,81
Umlaufende Anteile	59.593,653	31.773,000	7.960,234

