

Da Vinci Strategie UI Fonds

**Auflösungsbericht zum 31.07.2013
für das Rumpfgeschäftsjahr**

vom 01.10.2012 bis 31.07.2013

Tätigkeitsbericht

Das Sondervermögen strebt als Anlageziel einen möglichst hohen Wertzuwachs an. Im Sondervermögen sollen vorrangig Strategien mit börsengehandelten Optionen weltweit umgesetzt werden, um eine positive Wertentwicklung möglichst in jedem Marktumfeld zu erzielen. Innovative Aktienhandelsstrategien können Berücksichtigung finden. Zudem wird ein aktives Zinsmanagement betrieben.

Aufgrund des geringen Restvolumens und der bevorstehenden Fondsschließung per 31.07.2013 hat der Fonds im abgelaufenen Rumpfgeschäftsjahr keine aktive Strategie mehr verfolgt. Es wurden im Wesentlichen nur noch Veräußerungen der vorhandenen Bestände zur Schaffung der notwendigen Liquidität für Anteilsrückgaben und die Auflösung, sowie zur Anlage der aus Rentenrückstellungen resultierenden Liquidität getätigt.

Wesentliche Risiken bestanden nicht mehr.

Die Verwaltung des Fonds wurde von der BNY Mellon Service KAG zum 31.07.2013 gekündigt. Mit Ablauf des 31.07.2013 wurden die Bestände an die Depotbank übertragen, welche den Fonds liquidiert und die ausmachenden Beträge an die verbliebenen Anteilseigner verteilt hat.

Die Wertentwicklung des Fonds betrug bis zum 31.05.2013 -23.72 %. Das wesentliche Veräußerungsergebnis resultiert aus der Veräußerung der noch vorhandenen Renten- und Aktienpositionen.

Zusammengefasste Vermögensaufstellung

Aufteilung des Fondsvermögens nach Assetklassen

Assetklasse	Betrag	Anteil in %
Liquiditätsanlagen	148.205,25	111,77
Bankguthaben	148.205,25	111,77
Sonstige Verbindlichkeiten	-15.611,84	-11,77
Fondsvermögen	132.593,41	100,00

Vermögensaufstellung

31.07.2013

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.07.2013	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
Liquiditätsanlagen						148.205,25	111,77
Bankguthaben						148.205,25	111,77
Bankguthaben	EUR	148.205,25				148.205,25	111,77
Sonstige Verbindlichkeiten						-15.611,84	-11,77
Depotbankvergütung	EUR	-2.599,99				-2.599,99	-1,96
Prüfungskosten	EUR	-8.592,00				-8.592,00	-6,48
Verbindlichkeiten aus Anteilsscheingeschäften *	EUR	-3.546,00				-3.546,00	-2,67
Veröffentlichungskosten	EUR	-873,85				-873,85	-0,66
Fondsvermögen					EUR	132.593,41	100,00 **
Anteilwert					EUR	29,30	
Umlaufende Anteile					Stück	4,525	
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)							0,00
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)							0,00

* Noch nicht valutierte Transaktionen

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

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§9 Abs. 5 Satz 4 DerivateV)

JPM GBI BROAD ALL MATS. (E) - TOT RETURN IND	25 %	01.10.2012 bis	31.07.2013				
EURO STOXX 50	50 %	01.10.2012 bis	31.07.2013				
REX-P	25 %	01.10.2012 bis	31.07.2013				

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. §10 Abs. 1 Satz 2 und 3 DerivateV

Kleinster potenzieller Risikobetrag	0,00 %	(31.07.2013)					
Größter potenzieller Risikobetrag	4,85 %	(21.05.2013)					
Durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	3,02 %						

Die durchschnittliche Hebelwirkung aus der Nutzung von Derivaten betrug im Geschäftsjahr 1,00. Die Berechnung erfolgte unter Verwendung des Einfachen Ansatzes nach § 15ff DerivateV ohne Anwendung von § 15 Abs. 2 DerivateV in Bezug auf die Herausrechnung der Investmentanteile.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage der Investment-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung mit nachstehenden Kursen/Marktsätzen bewertet:

Wertpapierart	Region	Bewertungsdatum	§23 Bewertung mit handelbaren Kursen	§24 Bewertung mit Bewertungsmodellen	§25 Besonderheiten bei der Bewertung unternehmerischer Beteiligungen	§26 Besonderheiten bei Investmentanteilen, Bankguthaben und Verbindlichkeiten
Liquiditätsanlagen						
		31.07.2013				100,00 %
						100,00 %

Die prozentualen Angaben beziehen sich auf den Anteil der einzelnen Vermögensgegenstände am Fondsvermögen.

Die Bewertung erfolgt durch die Depotbank unter Mitwirkung der Kapitalanlagegesellschaft. Die Bewertung von börsengehandelten Vermögensgegenständen erfolgt mit entsprechend handelbaren Kursen. Sollten für diese Vermögensgegenstände keine handelbaren Kurse verfügbar sein, erfolgt die Bewertung auf Basis geeigneter Modelle. Bewertungseinheiten werden nicht gebildet.

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum			
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:					
Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheinanleihen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)					
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Fritz Nols AG Inhaber-Aktien DE0005070908	Stück	0	15.000		
Verzinsliche Wertpapiere					
4,000% Brandenburg, Land Schatzanw. 2003(13) DE0001076438	EUR	0	75.000		
0,000% Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.12/14 f.24.07.13 DE0001119642	EUR	50.000	50.000		
1,750% Niederlande EO-Anl. 2010(13) NL0009331461	EUR	0	65.000		
1,000% Niederlande EO-Anl. 2011(14) NL0009690593	EUR	45.000	45.000		
3,800% Österreich, Republik EO-MTN 2003(13) AT0000385992	EUR	50.000	50.000		
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Aktien					
Omni Ventures Inc. US68215X1054	Stück	100.000	350.000		
Verzinsliche Wertpapiere					
4,500% Hessen, Land Schatzanw. 2002(13) DE0001381663	EUR	0	65.000		

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge				
		im Berichtszeitraum					
Nichtnotierte Wertpapiere							
Aktien							
Fritz Nols AG Inhaber-Aktien DE000A1PHAR3	Stück	15.000	15.000				
Andere Wertpapiere							
Fritz Nols AG Inhaber-Bezugsrechte DE000A1PHAQ5	Stück	15.000	15.000				

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker eng verbundener Unternehmen und Personen abgewickelt wurden, beträgt 4,79 Prozent. Dies entspricht einem Volumen von 15.000,00 EUR von insgesamt 313.370,27 EUR Transaktionen.

Ertrags- und Aufwandsrechnung
für den Zeitraum vom 01.10.2012 bis 31.07.2013

	Gesamtwert in EUR	je Anteil in EUR
I. Erträge		
1. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	1.312,44	0,29
2. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	1.427,76	0,32
3. Sonstige Erträge*	9.150,18	2,02
Summe der Erträge	11.890,38	2,63
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	0,65	0,00
2. Verwaltungsvergütung	3.458,59	0,76
3. Depotbankvergütung	22.434,53	4,96
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	3.115,16	0,69
5. Sonstige Aufwendungen	9.758,19	2,16
Summe der Aufwendungen	38.767,12	8,57
III. Ordentlicher Nettoertrag	-26.876,74	-5,94
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	619,12	0,14
2. Realisierte Verluste	-30.262,09	-6,69
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	-29.642,97	-6,55
V. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	-56.519,71	-12,49

* Ertrag aus der Auflösung von Rückstellungen

Gesamtkostenquote (Ongoing Charges) in %	25,11
---	--------------

Die Ongoing Charges (Laufende Kosten) drückt die Summe aller Kosten und Gebühren (ohne Transaktionskosten, inkl. Zielfondskosten) als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvolumens innerhalb eines Geschäftsjahres aus.

Die Kosten aus Transaktionsumsätzen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens abgewickelt wurden, betragen 7,58 EUR.

Verwendungsrechnung

	Gesamtwert in EUR	je Anteil in EUR
I. Berechnung der Ausschüttung		
1. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	-56.519,71	-12,49
2. Zuführung aus dem Sondervermögen*	56.519,71	12,49
II. Zur Ausschüttung verfügbar	0,00	0,00

* Aufgrund des negativen Geschäftsergebnisses wurde eine Zuführung aus dem Sondervermögen vorgenommen.

Entwicklungsrechnung

	in EUR	in EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres		215.727,00
1. Mittelzufluss (netto)		-37.972,17
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	76,23	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-38.048,40	
2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-3.530,84
3. Ordentlicher Nettoertrag		-26.876,74
4. Realisierte Gewinne		619,12
5. Realisierte Verluste		-30.262,09
6. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne / Verluste		14.889,13
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Rumpfgeschäftsjahres		132.593,41

Die Gesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Depotbank oder an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen. Die Gesellschaft zahlt von der an sie abgeführten Verwaltungsvergütung keine Vergütung an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens auf den Bestand von vermittelten Anteilen.

Vergleichende Dreijahresübersicht

Geschäftsjahr	Fondsvermögen in EUR	Anteilswert in EUR
30.9.2011	852.321	47,52
30.6.2012 (Rumpfgeschäftsjahr)	308.583	46,17
30.9.2012 (Rumpfgeschäftsjahr)	215.727	38,41
31.7.2013 (Rumpfgeschäftsjahr)	132.593	29,30

Informationen zu den Steuerlichen Hinweisen erhalten Sie unter "info-kag@bnymellon. com"

Frankfurt am Main, den 11. Oktober 2013

BNY Mellon Service
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH
Frankfurt am Main
(Geschäftsführung)

Frankfurt am Main, den 11.10.2013

Auflösungsbericht Seite 14

Besonderer Vermerk des Abschlussprüfers

An die BNY Mellon Service Kapitalanlage-Gesellschaft mbH, Frankfurt am Main

Die BNY Mellon Service Kapitalanlage-Gesellschaft mbH hat uns beauftragt, gemäß § 44 Absatz 6 des Investmentgesetzes (InvG) den Auflösungsbericht des Sondervermögens Da Vinci Strategie UI Fonds für das Rumpfgeschäftsjahr vom 1. Oktober 2012 bis 31. Juli 2013 zu prüfen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter

Die Aufstellung des Auflösungsberichts nach den Vorschriften des InvG liegt in der Verantwortung der gesetzlichen Vertreter der Kapitalanlagegesellschaft.

Verantwortung des Abschlussprüfers

Unsere Aufgabe ist es, auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfung eine Beurteilung über den Auflösungsbericht abzugeben.

Wir haben unsere Prüfung nach § 44 Absatz 6 InvG unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung vorgenommen. Danach ist die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass Unrichtigkeiten und Verstöße, die sich auf den Auflösungsbericht wesentlich auswirken, mit hinreichender Sicherheit erkannt werden. Bei der Festlegung der Prüfungshandlungen werden die Kenntnisse über die Verwaltung des Sondervermögens sowie die Erwartungen über mögliche Fehler berücksichtigt. Im Rahmen der Prüfung werden die Wirksamkeit des rechnungslegungsbezogenen internen Kontrollsystems und die Nachweise für die Angaben im Auflösungsbericht überwiegend auf der Basis von Stichproben beurteilt. Die Prüfung umfasst die Beurteilung der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze für den

Auflösungsbericht und der wesentlichen Einschätzungen der gesetzlichen Vertreter der Kapitalanlagegesellschaft. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine hinreichend sichere Grundlage für unsere Beurteilung bildet.

Prüfungsurteil

Unsere Prüfung hat zu keinen Einwendungen geführt.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der Auflösungsbericht den gesetzlichen Vorschriften.

Frankfurt am Main, den 11. Oktober 2013

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Kuppler	Seiwert
Wirtschaftsprüfer	Wirtschaftsprüfer