

DIVERSIFIED HEDGEPORTFOLIO DYNAMIC

**Miteigentumsfonds nach österreichischem Recht (20a Investmentfondsgesetz 1993)
verwaltet durch die State Street Bank GmbH, Filiale Wien**

AT0000617584 / AT0000631635

ZWISCHENBERICHT ZUM HALBJAHRESENDE

(Dieser Fonds befindet sich seit 01.11.2009 in Abwicklung)

vom 1. Februar 2015 bis 31. Juli 2015

INHALTSVERZEICHNIS

| | |
|--|---|
| Verwaltung des Fonds seit Beginn der Abwicklung am 01.11.2009..... | 1 |
| Bericht an die Anteilshaber des Diversified HedgePortfolio Dynamic | 2 |
| Fondsdetails in EUR..... | 3 |
| Aufgliederung des Fondsvermögens zum 31.07.2015 in EUR..... | 5 |

VERWALTUNG DES FONDS SEIT BEGINN DER ABWICKLUNG AM 01.11.2009

Fondsverwaltung: State Street Bank GmbH, Filiale Wien
Schottengasse 4, 1010 Wien
T +43 1 253 93 103, F +43 1 253 93 499
Email: clientserviceaustria@statestreet.com

Abschlussprüfer: Ernst & Young,
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft m.b.H., Wien

ISIN: AT0000617584 Ausschüttende Tranche (A)
AT0000631635 Thesaurierende Tranche (T)

BERICHT AN DIE ANTEILSINHABER DES DIVERSIFIED HEDGEPORTFOLIO DYNAMIC

Dieser Fonds befindet sich seit 01.11.2009 in Abwicklung. Aufgrund §63 des seit 2011 geltenden Investmentfondsgesetzes 2011 wird dieser Bericht erstellt. Die Bestimmungen des Investmentfondsgesetzes wurden bei diesem in Abwicklung befindlichen Fonds analog angewandt, soweit sinnvolle Daten zur Erstellung des Berichtes verfügbar waren.

Informationen zur Abwicklung des Fonds

Ursprünglich wurde im Jahre 2009 angenommen, dass das Ende der Abwicklungsphase mit 31.10.2011 erreicht sein wird. Während der Abwicklung hat sich allerdings durch die Natur der Bestände eine Verlängerung der Abwicklungsphase ergeben. Seit Beginn der Abwicklung konnten EUR 26.973.598,08 an die Anteilscheininhaber ausgezahlt werden.

Im Kalenderjahr 2014 konnte für alle noch im Fonds befindlichen Sub-Hedgefonds-Bestände am Sekundärmarkt ein Käufer gefunden werden. Die finale Abwicklung des Fonds kann somit durch Abschluss des Verkaufsprozesses und Vereinnahmung des Kaufpreises im Kalenderjahr 2015 durchgeführt werden. Aus heutiger Sicht wird das Ende der Abwicklungsphase im Oktober 2015 erreicht sein und die Auszahlung des liquiden Nettovermögens an die Anteilseigner kann dann durchgeführt werden. Sobald der Fonds als abgewickelt gilt, werden die Lagerstellen mittels einer entsprechenden Meldung durch die State Street Bank GmbH an die Österreichische Kontrollbank AG über diesen Umstand informiert. Die Lagerstellen und die jeweiligen depotführenden Stellen der Anteilseigner werden dann die Bestände am Diversified HedgePortfolio Dynamic ausbuchen.

Sobald die Schließung des Fonds erfolgen konnte wird ein finaler Abschlussbericht erstellt.

FONDSDETAILS IN EUR

| | 31.07.2015 | 31.01.2015 |
|---|------------|------------|
| Fondsvermögen | 700.166,34 | 701.757,09 |
| Ausschüttende Tranche (ISIN AT0000617584) | | |
| Rechenwert je Anteil | 1,85 | 1,85 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 21.315 | 21.315 |
| Thesaurierende Tranche (ISIN AT0000631635) | | |
| Rechenwert je Anteil | 2,18 | 2,19 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 301.758 | 301.758 |

BANKGUTHABEN

| WÄHRUNG | FONDSWÄHRUNG | BETRAG FONDSWÄHRUNG |
|---------------------------|---------------------|--------------------------------|
| EURO | EUR | 700.166,34 |
| SUMME BANKGUTHABEN | | 700.166,34 |

AUFGLIEDERUNG DES FONDSVERMÖGENS ZUM 31.07.2015 IN EUR

| | EUR | % |
|------------------------------------|-------------------|---------------|
| Bankguthaben | 700.166,34 | 100,00 |
| FONDSVERMÖGEN ¹⁾ | 700.166,34 | 100,00 |

1) Das Fondsvermögen eines in Abwicklung befindlichen Fonds kann bis zur finalen Auszahlung nur ein indikativer Wert sein und dient nur Informationszwecken.

Wien, im September 2015

State Street Bank GmbH
Filiale Wien

Mag. Madeleine Egger

Bernhard Schober