

Halbjahresbericht zum 31. März 2020

Manganina Multi Asset

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie über
die Entwicklung des offenen inländischen Publikums-AIF
(Sonstige Investmentvermögen)

Manganina Multi Asset

in der Zeit vom 1. Oktober 2019 bis 31. März 2020.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von - 10,57 %.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des
Sondervermögens im Detail per Ende März darstellte. Abseits dessen stehen wir Ihnen
aber auch für weitere Fragen gern zur Verfügung und verbleiben

mit herzlichen Grüßen

Ihre
HANSAINVEST-Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz, Nicholas Brinckmann, Andreas Hausladen, Ludger Wibbeke

Hamburg, im Mai 2020

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensübersicht per 31. März 2020	4
Vermögensaufstellung per 31. März 2020	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	13
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	15

Vermögensübersicht per 31. März 2020

Fondsvermögen: EUR 14.153.485,19 (14.752.960,73)

Umlaufende Anteile: 1.560.970 (1.455.045)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens per 30.09.2019
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien	1.802	12,73	(14,68)
2. Anleihen	6.539	46,20	(48,45)
3. Zertifikate	322	2,28	(1,90)
4. Sonstige Wertpapiere	2.885	20,38	(14,81)
5. Derivate	-548	-3,87	(-1,17)
6. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	1.116	7,89	(8,60)
7. Bankguthaben	1.963	13,87	(12,25)
8. Sonstige Vermögensgegenstände	102	0,72	(0,66)
II. Verbindlichkeiten	-28	-0,20	(-0,18)
III. Fondsvermögen	14.153	100,00	

Vermögensaufstellung per 31. März 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2020	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
					im Berichtszeitraum					
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Allianz	DE0008404005		STK	250	0	0	EUR	152,840000	38.210,00	0,27
Anheuser-Busch InBev	BE0974293251		STK	1.500	0	0	EUR	38,905000	58.357,50	0,41
BASF	DE000BASF111		STK	1.000	0	0	EUR	42,455000	42.455,00	0,30
Bayer	DE000BAY0017		STK	542	0	1.000	EUR	52,680000	28.552,56	0,20
Deutsche Post	DE0005552004		STK	1.600	0	0	EUR	24,560000	39.296,00	0,28
Fresenius 3)	DE0005785604		STK	2.200	700	0	EUR	33,885000	74.547,00	0,53
Henkel 3)	DE0006048432		STK	1.000	1.000	0	EUR	71,280000	71.280,00	0,50
Kering	FR0000121485		STK	90	0	0	EUR	481,500000	43.335,00	0,31
Orange	FR0000133308		STK	8.000	2.500	0	EUR	11,210000	89.680,00	0,63
Royal Dutch Shell	GB00B03MLX29		STK	4.000	1.000	0	EUR	15,150000	60.600,00	0,43
Siemens Healthineers AG	DE000SHL1006		STK	1.000	0	0	EUR	35,635000	35.635,00	0,25
Total S.A.	FR0000120271		STK	1.500	0	0	EUR	33,570000	50.355,00	0,35
Unilever N.V. Aandelen op naam EO -,16 3)	NL0000388619		STK	3.000	1.000	0	EUR	43,750000	131.250,00	0,93
Nestlé	CH0038863350		STK	900	0	0	CHF	99,800000	84.843,90	0,60
Novartis	CH0012005267		STK	600	0	0	CHF	77,800000	44.093,89	0,31
Aviva	GB0002162385		STK	5.000	5.000	0	GBP	2,678000	15.073,74	0,11
H & M Hennes & Mauritz	SE0000106270		STK	1.200	0	0	SEK	122,260000	13.244,74	0,09
Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shs (sp.ADRs)/1 DL-,000025	US01609W1027		STK	160	0	0	USD	191,270000	27.746,68	0,20
Bank of America	US0605051046		STK	1.100	0	0	USD	22,040000	21.981,05	0,16
EOG Resources	US26875P1012		STK	1.000	1.000	0	USD	34,980000	31.714,95	0,22
Fedex 3)	US31428X1063		STK	500	500	0	USD	124,310000	56.353,42	0,40
JPMorgan Chase	US46625H1005		STK	300	0	0	USD	93,500000	25.431,80	0,18
Nike	US6541061031		STK	400	0	0	USD	85,380000	30.964,23	0,22
Schlumberger	AN8068571086		STK	2.000	0	0	USD	13,280000	24.080,87	0,17
ViacomCBS Cl. B	US92556H2067		STK	2.000	2.000	0	USD	14,085000	25.540,60	0,18
VISA	US92826C8394		STK	240	0	0	USD	165,570000	36.027,74	0,25
Verzinsliche Wertpapiere										
4,250000000% Achmea B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 15(25/Und.)	XS1180651587		EUR	100	0	0	%	90,117750	90.117,75	0,64
0,022990000% AEGON EO-FLR-Nts 047(14/Und.)	NL0000116150		EUR	100	0	0	%	57,475000	57.475,00	0,41
1,700000000% Altria Group Inc. EO-Notes 19/25	XS1843443513		EUR	100	0	0	%	98,525000	98.525,00	0,70
2,750000000% Arkema S.A. EO-FLR Notes 2019(24/Und.)	FR0013425170		EUR	100	100	0	%	90,396000	90.396,00	0,64
2,125000000% Aaroundtown SA EO-FLR Notes 2018(24/Und.)	XS1752984440		EUR	100	100	0	%	87,826000	87.826,00	0,62
2,375000000% Barry Callebaut Services N.V. EO-Notes 2016(24)	BE6286963051		EUR	200	0	0	%	99,231000	198.462,00	1,40
3,750000000% Bayer AG FLR-Sub. Anl.v.2014(2024/2074)	DE000A11QR73		EUR	80	0	40	%	94,265250	75.412,20	0,53
4,250000000% BayWa AG Sub.-FLR-Nts.v.17(22/und.)	XS1695284114		EUR	200	0	0	%	94,050000	188.100,00	1,33

Vermögensaufstellung zum 31.03.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2020	Käufe/ Zugänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
						Verkäufe/ Abgänge			
3,000000000% Bertelsmann SE & Co. KGaA FLR-Sub. Anl. v.2015(2023/2075)	XS1222591023		EUR	200	0	0	% 92,367500	184.735,00	1,31
1,000000000% BMW US Capital LLC EO-MTN 15/27	DE000A1ZZ028		EUR	40	0	0	% 92,488000	36.995,20	0,26
1,750000000% Danone S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 17(23/Und.)	FR0013292828		EUR	100	0	0	% 96,264000	96.264,00	0,68
0,389000000% Deutsche Bank AG FLR-MTN v.17(22)	DE000DL19TQ2		EUR	100	0	0	% 95,415000	95.415,00	0,67
2,875000000% Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr. FLR-MTN R35281 17(22/27)	XS1637926137		EUR	200	200	0	% 92,109000	184.218,00	1,30
4,000000000% Electricité de France (E.D.F.) EO-FLR MTN 18(24/Und.)	FR0013367612		EUR	100	100	0	% 96,985000	96.985,00	0,69
3,250000000% Eurofins Scientific S.E. EO-FLR Notes 2017(25/Und.)	XS1716945586		EUR	200	200	0	% 84,375000	168.750,00	1,19
2,125000000% Evonik Industries AG FLR-Nachr.-Anl. v.17(22/77)	DE000A2GSFF1		EUR	150	0	60	% 94,486783	141.730,17	1,00
2,250000000% HeidelbergCement EO-MTN 16/23	XS1387174375		EUR	200	0	0	% 100,857678	201.715,36	1,43
1,787000000% HT1 Funding GmbH FLR-Anl. v.06(17/ unb.)	DE000A0KAA7		EUR	50	0	0	% 97,425000	48.712,50	0,34
2,625000000% K+S Aktiengesellschaft Anleihe v.17/23	XS1591416679		EUR	100	100	0	% 79,625000	79.625,00	0,56
2,375000000% MAHLE GmbH MTN v.2015(2022)	XS1233299459		EUR	200	0	0	% 86,825000	173.650,00	1,23
2,625000000% Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2014(2021/2074)	XS1152338072		EUR	50	0	0	% 97,260500	48.630,25	0,34
4,625000000% NN Group N.V. EO-FLR Bonds 2014(24/44)	XS1054522922		EUR	100	0	0	% 102,692500	102.692,50	0,73
5,250000000% OMV AG EO-FLR Notes 2015(21/Und.)	XS1294342792		EUR	50	0	0	% 101,215500	50.607,75	0,36
2,500000000% Otto (GmbH & Co KG) MTN v.2016(2016/2023)	XS1433512891		EUR	100	0	0	% 96,129500	96.129,50	0,68
2,625000000% Otto (GmbH & Co KG) MTN v.2019(2019/2026)	XS1979274708		EUR	200	0	0	% 95,152000	190.304,00	1,34
2,000000000% Peugeot S.A. EO-MTN 17/24	FR0013245586		EUR	200	0	0	% 96,351000	192.702,00	1,36
5,650000000% Portugal 13/24	PTOTE00E0015		EUR	40	0	0	% 121,849000	48.739,60	0,34
2,875000000% Smurfit Kappa Acquis. Unl. EO-Nts 18/26 Reg.S	XS1849518276		EUR	200	0	0	% 97,870500	195.741,00	1,38
2,500000000% Stora Enso Oyj EO-Medium-Term Nts 2017(17/27)	XS1624344542		EUR	100	100	0	% 99,189500	99.189,50	0,70
2,250000000% Total S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 15(21/ Und.)	XS1195201931		EUR	100	0	0	% 99,746500	99.746,50	0,70
2,125000000% TUI Reg. S 16/21	XS1504103984		EUR	100	100	0	% 88,824000	88.824,00	0,63
2,500000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2015(22/Und.)	XS1206540806		EUR	300	0	0	% 94,698038	284.094,11	2,01
5,250000000% Württemb.Lebensversicherung FLR-Nachr.-Anl. 14/24/44	XS1064049767		EUR	200	0	0	% 102,125000	204.250,00	1,44
4,099500000% Alpiq Holding AG SF-FLR Anl. 2013(18/ Und.)	CH0212184037		CHF	50	0	0	% 89,075000	42.070,09	0,30
2,500000000% HOCHDORF Holding AG SF-FLR Anl. 2017(23/Und.)	CH0391647986		CHF	200	40	0	% 48,200000	91.059,37	0,64
3,500000000% Siegfried Holding AG SF-FLR Anl. 2015(20/Und.)	CH0297343573		CHF	50	0	0	% 96,125000	45.399,80	0,32
3,750000000% Swiss Life AG SF-Var. Anl. 2016(21/Und.)	CH0316994646		CHF	50	0	0	% 100,619500	47.522,55	0,34
1,375000000% Kreditanst.f.Wiederaufbau LS-MTN 16/21	XS1346200055		GBP	50	50	0	% 100,817000	56.747,16	0,40
1,192500000% Royal Bank of Canada LS-FLR Mortg.Cov. MTN 2019(24)	XS2060621005		GBP	100	100	0	% 97,826500	110.127,77	0,78
5,500000000% Allianz Subord. Bond 12/18/unb.	XS0857872500		USD	200	0	0	% 95,184000	172.598,94	1,22
5,450000000% Dell Intern. LLC/EMC Corp. DL-Notes 2016(16/23) Reg.S	USU2526DAC30		USD	50	0	0	% 101,630000	46.071,90	0,33
3,750000000% Vodafone Group PLC DL-Notes 2018(18/24)	US92857WBH25		USD	200	200	0	% 102,702000	186.231,47	1,32

Vermögensaufstellung zum 31.03.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2020	Käufe/ Zugänge		Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum					
Sonstige Beteiligungswertpapiere										
Roche (Genussscheine)	CH0012032048		STK	190	0	0	0	CHF 308,800000	55.421,53	0,39
Summe der börsengehandelten Wertpapiere								EUR	6.150.661,14	43,46
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere										
Aktien										
Alphabet Inc. Reg.Sh. Capi Stk Class C o.N.	US02079K1079		STK	30	0	0	0	USD 1.146,820000	31.193,25	0,22
Amazon.com	US0231351067		STK	10	0	0	0	USD 1.963,950000	17.806,34	0,13
Apple	US0378331005		STK	100	0	0	0	USD 254,810000	23.102,59	0,16
Baidu Inc. 3)	US0567521085		STK	700	0	0	0	USD 98,950000	62.799,76	0,44
Cisco Systems 3)	US17275R1023		STK	3.000	3.000	0	0	USD 40,320000	109.669,52	0,77
Facebook Inc.	US30303M1027		STK	170	0	0	0	USD 165,950000	25.578,22	0,18
Gilead Sciences 3)	US3755581036		STK	3.500	0	0	0	USD 75,930000	240.949,27	1,70
PayPal Holdings	US70450Y1038		STK	400	0	0	0	USD 97,030000	35.189,27	0,25
Verzinsliche Wertpapiere										
2,125000000% Stora Enso Oyj EO-Med.-T. Notes 2016(16/23)	XS1432392170		EUR	200	0	0	0	% 102,524500	205.049,00	1,45
0,500000000% Wirecard AG Anleihe v.19/24	DE000A2YNQ58		EUR	300	200	0	0	% 86,160000	258.480,00	1,83
0,750000000% Kon. Luchtvaart Mij. N.V. SF-FLR Anl. 1985(95/Undated)	CH0005362055		CHF	150	150	0	0	% 29,312500	41.532,85	0,29
2,511000000% Bank of America Corp. DL-FLR MTN 2018(25/26)	US06051GHB86		USD	100	0	0	0	% 88,255900	80.018,04	0,57
2,625000000% Bank of America Corp. DL-Notes 2015(20)	US06051GFT13		USD	70	0	0	0	% 99,731000	63.295,43	0,45
3,625000000% Dow Chemical Co., The DL-Notes 2019(19/26)	US260543CX94		USD	200	200	0	0	% 99,640000	180.679,09	1,28
6,625000000% Nokia OYJ DL-Notes 2009(09/39)	US654902AC90		USD	200	100	0	0	% 95,750000	173.625,28	1,22
3,000000000% ADLER Real Estate AG Anleihe v. 18/26	XS1713464524		EUR	200	0	0	0	% 86,074500	172.149,00	1,22
2,375000000% Bayer AG FLR-Sub. Anl.v.2019(2025/2079)	XS2077670003		EUR	200	200	0	0	% 88,531166	177.062,33	1,25
2,000000000% DekaBank Dt.Girozentrale Indexanl. 16(21) DAX	DE000DK0GPA7		EUR	100	100	0	0	% 96,670000	96.670,00	0,68
2,125000000% Imperial Brands Finance PLC EO-Medium-Term Nts 2019(19/27)	XS1951313763		EUR	200	200	0	0	% 98,073000	196.146,00	1,39
Zertifikate										
Xetra-Gold	DE000A0S9GB0		STK	2.000	0	0	0	EUR 47,308000	94.616,00	0,67
BNP Paribas Em.-u.Handelsg.mbH DISC.Z 02.07.20 ESTX50 3600	DE000PX3U2B1		STK	2.300	2.300	0	0	EUR 27,320000	62.836,00	0,44
DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 02.10.20 DAX 8800	DE000DF3EES9		STK	1.200	1.200	0	0	EUR 81,880000	98.256,00	0,69
DZ BANK AG Deut.Zentral-Gen. DISC.Z 28.08.20 ESTX50 1500	DE000DFA9480		STK	4.500	4.500	0	0	EUR 14,770000	66.465,00	0,47
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere								EUR	2.513.168,24	17,75
Investmentanteile										
KVG-eigene Investmentanteile										
Aramea Rendite Plus A	DE000A0NEKQ8		ANT	600	0	0	0	EUR 160,940000	96.564,00	0,68
Themis Special Situations Fund	DE000A2H6764		ANT	3.000	0	0	0	EUR 89,100000	267.300,00	1,89
Gruppenfremde Investmentanteile										
ACATIS IFK VALUE RENTEN UI	DE000A0X7582		ANT	2.000	0	0	0	EUR 43,890000	87.780,00	0,62
CONVERTIBLE GLB.DIVERSIFIED UI Inhaber-Anteile	DE000A0M9995		ANT	1.900	0	0	0	EUR 141,230000	268.337,00	1,90
Fidelity Fds-Pacific Fund Registered Shs Y Acc. EUR o.N.	LU0951203180		ANT	5.000	0	0	0	EUR 13,940000	69.700,00	0,49
iShares ESTXX Banks 30-15 UC.ETF	DE0006289309		ANT	5.000	0	0	0	EUR 5,331000	26.655,00	0,19
ISHARES MSCI JAPAN	IE00B02KXH56		ANT	7.000	0	0	0	EUR 11,564000	80.948,00	0,57
iShares ST.Eu.600 Oil&Gas U.ETF DE	DE000A0H08M3		ANT	1.100	0	0	0	EUR 20,660000	22.726,00	0,16

Vermögensaufstellung zum 31.03.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2020	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum					
iShs II-\$Hgh Yd Corp Bd UC.ETF Registered Shares o.N.	IE00B4PY7Y77		ANT	400	0	0	0	EUR 83,356000	33.342,40	0,24
iShs-EO Corp.Bd Lar. Cap UCITS Registered Shares o.N.	IE0032523478		ANT	300	0	0	0	EUR 131,180000	39.354,00	0,28
iShsIII-EM Local Govt Bd.U.ETF Registered Shares USD o.N.	IE00B5M4WH52		ANT	1.000	0	0	0	EUR 45,913000	45.913,00	0,32
OptoFlex Inhaber-Ant. I (thes.)EUR o.N.	LU0834815101		ANT	400	400	0	0	EUR 1.278,610000	511.444,00	3,61
UnilInstit.Convertibles Protect	LU0200666799		ANT	5.450	0	0	0	EUR 73,340000	399.703,00	2,82
Vanguard FTSE 250 UCITS ETF Registered Shares GBP Dis.oN	IE00BKX55Q28		ANT	1.400	1.400	0	0	EUR 25,595000	35.833,00	0,25
Danske Invest Fund FCP- Russia Namens-Anteile I o.N.	LU0495011370		ANT	2.800	0	0	0	USD 15,445000	39.209,39	0,28
WHITE FLEET III-F.Pr.St.Inc.Fd Act. Nom. ST USD Acc. oN	LU2003575581		ANT	1.100	1.100	0	0	USD 863,110000	860.801,49	6,08
Summe der Investmentanteile								EUR	2.885.610,28	20,38
Summe Wertpapiervermögen								EUR	11.549.439,66	81,59
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
Optionsrechte										
Wertpapier-Optionsrechte Forderungen/Verbindlichkeiten										
Optionsrechte auf Aktien										
Put Abbott Laboratories 80,000000000 19.06.2020		XNAS	STK	-1500				USD 7,025000	-9.553,92	-0,07
Put Unilever N.V. 52,000000000 19.06.2020		XEUR	STK	-1500				EUR 8,890000	-13.335,00	-0,09
Call Unilever N.V. 56,000000000 19.06.2020		XEUR	STK	-1000				EUR 0,070000	-70,00	0,00
Put Danone 72,000000000 19.06.2020		XEUR	STK	-1500				EUR 16,410000	-24.615,00	-0,17
Put AXA 22,500000000 19.06.2020		XEUR	STK	-600				EUR 7,700000	-46.200,00	-0,33
Put Danone 72,000000000 19.06.2020		XEUR	STK	-500				EUR 16,410000	-8.205,00	-0,06
Put Cap Gemini 96,000000000 19.06.2020		XEUR	STK	-1000				EUR 19,600000	-19.600,00	-0,14
Put Sanofi 80,000000000 19.06.2020		XEUR	STK	-1500				EUR 6,650000	-9.975,00	-0,07
Put Cap Gemini 96,000000000 19.06.2020		XEUR	STK	-500				EUR 19,600000	-9.800,00	-0,07
Put Cie Financière Richemont Option 73,000000000 19.06.2020		XEUR	STK	-15				CHF 21,140000	-29.953,24	-0,21
Put Allianz Option 210,000000000 19.06.2020		XEUR	STK	-5				EUR 61,680000	-30.840,00	-0,22
Call Henkel 96,000000000 19.06.2020		XEUR	STK	-10				EUR 0,030000	-30,00	0,00
Put Vivendi 24,000000000 18.09.2020		XEUR	STK	-4000				EUR 6,550000	-26.200,00	-0,19
Put ALEXION PHARMAC Inc Option 100,000000000 19.06.2020		XNYS	STK	-1000				USD 15,750000	-14.279,89	-0,10
Put DuPont de Nemours 60,000000000 19.06.2020		XNAS	STK	-1500				USD 27,200000	-36.991,70	-0,26
Call Cisco Systems 52,500000000 19.06.2020		XCBO	STK	-1000				USD 0,135000	-122,40	0,00
Call Baidu 150,000000000 19.06.2020		XNYS	STK	-700				USD 0,280000	-177,71	0,00
Put Broadcom 280,000000000 19.06.2020		XNAS	STK	-400				USD 50,950000	-18.477,72	-0,13
Call Cisco Systems 52,500000000 19.06.2020		XCBO	STK	-2000				USD 0,135000	-244,80	0,00
Put Walt Disney Co. 140,000000000 18.09.2020		XNAS	STK	-1000				USD 42,125000	-38.193,03	-0,27
Call Fresenius SE Call Juni 2020 54,00 54,000000000 19.06.2020		XEUR	STK	-700				EUR 0,020000	-14,00	0,00
Put Unilever N.V. 52,000000000 19.06.2020		XEUR	STK	-1000				EUR 8,890000	-8.890,00	-0,06
Put DuPont de Nemours 60,000000000 19.06.2020		XNAS	STK	-500				USD 27,200000	-12.330,57	-0,09
Call Gilead Sciences 80,000000000 15.01.2021		XNAS	STK	-3500				USD 8,950000	-28.401,11	-0,20
Put Facebook 200,000000000 18.09.2020		XNAS	STK	-700				USD 38,925000	-24.704,20	-0,17
Call FedEx Corp. 165,000000000 19.06.2020		XNAS	STK	-500				USD 0,840000	-380,80	0,00
Put IBM 145,000000000 15.01.2021		XNAS	STK	-1000				USD 38,000000	-34.453,06	-0,24
Put Alphabet 1440,000000000 15.01.2021		XNAS	STK	-100				USD 322,000000	-29.194,43	-0,21
Put MEDTRONIC PLC 105,000000000 15.01.2021		XNAS	STK	-1000				USD 21,850000	-19.810,51	-0,14

Vermögensaufstellung zum 31.03.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Put Kering S.A. 560,000000000 18.09.2020		XEUR	STK	-100			EUR 104,010000	-10.401,00	-0,07
Put Microsoft 155,000000000 15.01.2021		XNAS	STK	-600			USD 17,275000	-9.397,52	-0,07
Put Novartis 80,000000000 18.09.2020		XEUR	STK	-800			CHF 7,110000	-5.372,88	-0,04
Put SAP 100,000000000 15.05.2020		XEUR	STK	-500			EUR 6,480000	-3.240,00	-0,02
Summe der Optionsrechte auf Aktien							EUR	-523.454,49	-3,69
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Aktienindices									
Put ESTX 50 Option 2650,000000000 17.07.2020		XEUR	STK	-30			EUR 206,800000	-6.204,00	-0,04
Put S&P 500 Index Options 2500,000000000 19.06.2020		XCBO	STK	-100			USD 165,450000	-15.000,68	-0,11
Summe der Aktienindex-Derivate							EUR	-21.204,68	-0,15
Devisen-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Verkauf)									
Offene Positionen									
USD/EUR 0,30 Mio.		OTC						-3.684,38	-0,03
Summe der Devisen-Derivate							EUR	-3.684,38	-0,03

Vermögensaufstellung zum 31.03.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2020	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
Bankguthaben und Geldmarktfonds									
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG			EUR	1.419.226,45				1.419.226,45	10,03
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:									
Verwahrstelle: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG			CHF	63.971,37				60.427,31	0,43
Verwahrstelle: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG			USD	527.699,82				478.444,01	3,38
			GBP	4.054,00				4.563,77	0,03
Summe der Bankguthaben							EUR	1.962.661,54	13,87
Gruppenfremde Geldmarktfonds									
BNP Paribas InstiCash - EUR Namens-Anteile I Cap.o.N.	LU0094219127		ANT	8.057	0	1.082	EUR 138,550200	1.116.256,98	7,89
Summe der Geldmarktfonds							EUR	1.116.256,98	7,89
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	95.967,44				95.967,44	0,68
Dividendenansprüche			EUR	4.609,32				4.609,32	0,03
Ansprüche auf Ausschüttung			EUR	425,49				425,49	0,00
Quellensteueransprüche			EUR	873,00				873,00	0,01
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	101.875,25	0,72
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-28.404,69			EUR	-28.404,69	-0,20
Fondsvermögen							EUR	14.153.485,19	100 2)
Anteilwert							EUR	9,067	
Umlaufende Anteile							STK	1.560.970	

Fußnoten:

1) noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Beratervergütung, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung

2) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise Gegenstand eines Stillhaltergeschäftes in Wertpapieren.

Gesamtbetrag der Kurswerte der Wertpapiere, die Gegenstand von Optionsrechten Dritter sind: 6.568.845,00 EUR

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)		per 31.03.2020	
Schweizer Franken	CHF	1,058650	= 1 Euro (EUR)
Britisches Pfund	GBP	0,888300	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	SEK	11,077000	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,102950	= 1 Euro (EUR)
Marktschlüssel			
b) Terminbörsen			
XNAS	NASDAQ - ALL MARKETS		
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND		
XNYS	NEW YORK STOCK EXCHANGE, INC.		
XCBO	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE		
c) OTC			
	Over-the-Counter		

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Corteva	US22052L1044	STK	-	666	
DuPont de Nemours Inc. Registered Shares o.N.	US26614N1028	STK	-	666	
General Electric	US3696041033	STK	-	7.500	
Verzinsliche Wertpapiere					
6,000000000% Achmea B.V. EO-Medium-T. Nts 2006(12/Und.)	NL0000168714	EUR	-	110	
1,125000000% B.A.T. Capital Corp. EO-Med.-Term Nts 2017(23/23)	XS1664644710	EUR	150	150	
0,875000000% BASF SE Anleihe v.2017(2027)	XS1718418103	EUR	-	40	
2,375000000% Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2015(2022/2075)	DE000A14J611	EUR	-	200	
1,500000000% Deutsche Bank AG MTN 17/22	DE000DL19TA6	EUR	-	200	
2,875000000% Dürr AG Anleihe v. 14/21	XS1048589458	EUR	-	100	
3,250000000% K+S Aktiengesellschaft Anleihe v.18/24	XS1854830889	EUR	-	200	
1,500000000% Kraft Heinz Foods Co. EO-Notes 16/24	XS1405782407	EUR	-	100	
3,375000000% Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2014(2024/2074)	XS1152343668	EUR	-	150	
1,250000000% RCI Banque EO-MTN 15/22	FR0012759744	EUR	-	100	
1,125000000% Sixt Leasing SE Anleihe v.2017(2021)	DE000A2DADR6	EUR	-	200	
3,875000000% Total S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 16(22/Und.)	XS1413581205	EUR	-	100	
8,375000000% Crédit Agricole S.A. DL-FLR Nts 2009(19/Und.) Reg.S	USF22797FK97	USD	-	100	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Aktien					
Alphabet Inc. Reg.Sh. Capi Stk Class A o.N.	US02079K3059	STK	-	40	
Applied Materials	US0382221051	STK	-	2.500	
Electronic Arts Inc. Registered Shares DL -,01	US2855121099	STK	-	700	
Kraft Heinz Co., The Registered Shares DL -,01	US5007541064	STK	-	2.000	
NortonLifeLock Inc.	US6687711084	STK	3.000	3.000	
Symantec	US8715031089	STK	-	3.000	
Verzinsliche Wertpapiere					
1,375000000% ThyssenKrupp AG Medium Term Notes v.17(2022)	DE000A2BPET2	EUR	-	200	
3,600000000% AbbVie Inc. DL-Notes 2015(15/25)	US00287YAQ26	USD	-	110	
2,400000000% Apple 13/23	US037833AK68	USD	-	70	
3,625000000% Dow Chemical Co., The DL-Notes 2019(19/26) Reg.S	USU26054KL63	USD	-	200	
1,625000000% United States of America DL-Notes 16/23	US912828T917	USD	-	90	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
Alegra High Grade ABS Portfol. Inhaber-Anteile o.N.	LI0027320568	ANT	-	190	
Flossbach von Storch - Bond Opportunities I	LU0399027886	ANT	-	1.000	
iShs DL Corp Bond UCITS ETF Registered Shares o.N.	IE0032895942	ANT	-	700	

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Zinsterminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: Bundesrep. Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe		EUR			516,60
Aktienindex-Terminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: S&P 500 Index		USD			132,83
Zinsterminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
Basiswert: Euro/US-Dollar		USD			252,86
Optionsrechte					
Wertpapier-Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktien					
Gekaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: Applied Materials		USD			5,51
Verkaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswerte: Anheuser-Busch InBev, Royal Dutch Shell		EUR			4,36
Basiswerte: Baidu Inc., ViacomCBS Cl. B, Fedex , NortonLifeLock Inc., EOG Resources, Schlumberger		USD			12,02
Verkaufte Verkaufsoptionen(Put):					
Basiswerte: Colgate-Palmolive , ViacomCBS Cl. B, Alexion Pharmaceuticals, Microsoft Corp., Intl Business Machines		USD			21,14
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices:					
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: DAX Index		EUR			13,37

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 1.204.574,03

Der Wert ergibt sich unter Berücksichtigung von Netting- und Hedgingeffekten, der zugrundeliegenden Derivate im Sondervermögen

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	81,59
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-3,87

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	9,067
Umlaufende Anteile	STK	1.560.970

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Der Anteilwert wird durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH ermittelt. Die Bewertung von Vermögenswerten, die an einer Börse zum Handel zugelassen bzw. in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind, erfolgt zu den handelbaren Schlusskursen des vorhergehenden Börsentages gem. § 27 KARBV. Investmentanteile werden zu den letzten veröffentlichten Rücknahmepreisen angesetzt.

Vermögenswerte, die weder an einer Börse zugelassen noch in einen organisierten Markt einbezogen sind oder für die ein handelbarer Kurs nicht verfügbar ist, werden mit von anerkannten Kursversorgern zur Verfügung gestellten Kursen bewertet. Sollten die ermittelten Kurse nicht belastbar sein, wird auf den mit geeigneten Bewertungsmodellen ermittelten Verkehrswert abgestellt (§ 28 KARBV). Die bezogenen Kurse werden täglich durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft auf Vollständigkeit und Plausibilität geprüft.

Bankguthaben und Festgelder werden mit dem Nominalbetrag und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet. Die Bewertung der sonstigen Vermögensgegenstände erfolgt zu ihrem Markt- bzw. Nominalbetrag.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütung und Aufwandsersatzungen. Die KVG gewährt keine sogenannte Vermittlungsfolgebprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Verwaltungsvergütungssatz für im Sondervermögen gehaltene Investmentanteile

Die Verwaltungsvergütung für KVG- und Gruppeneigene Investmentanteile beträgt:

Aramea Rendite Plus A	1,2500 %
Themis Special Situations Fund	0,7200 %

Die Verwaltungsvergütung für Gruppenfremde Investmentanteile beträgt:

ACATIS IFK VALUE RENTEN UI	0,9900 %
CONVERTIBLE GLB.DIVERSIFIED UI Inhaber-Anteile	0,4000 %
Fidelity Fds-Pacific Fund Registered Shs Y Acc. EUR o.N.	0,8000 %
iShares ESTXX Banks 30-15 UC.ETF	0,5000 %
ISHARES MSCI JAPAN	0,5900 %
iShares ST.Eu.600 Oil&Gas U.ETF DE	0,5000 %
iShs II-\$Hgh Yd Corp Bd UC.ETF Registered Shares o.N.	0,5000 %
iShs-EO Corp.Bd Lar. Cap UCITS Registered Shares o.N.	0,2000 %
iShsIII-EM Local Govt Bd.U.ETF Registered Shares USD o.N.	0,5000 %
OptoFlex Inhaber-Ant. I (thes.)EUR o.N.	0,7000 %
Unilnstit.Convertibles Protect	0,7000 %
Vanguard FTSE 250 UCITS ETF Registered Shares GBP Dis.oN	0,1000 %
Danske Invest Fund FCP- Russia Namens-Anteile I o.N.	1,0000 %
WHITE FLEET III-F.Pr.St.Inc.Fd Act. Nom. ST USD Acc. oN	0,7000 %
Alegra High Grade ABS Portfol. Inhaber-Anteile o.N.	0,2500 %
Flossbach von Storch - Bond Opportunities I	0,4300 %
iShs DL Corp Bond UCITS ETF Registered Shares o.N.	0,2000 %
BNP Paribas InstiCash - EUR Namens-Anteile I Cap.o.N.	0,1500 %

Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeaufschläge wurden nicht berechnet.

Beschreibung, wie die Vergütungen und ggf. sonstige Zuwendungen berechnet wurden

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die Ausgestaltung des Vergütungssystems hat die Gesellschaft in einer internen Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis geregelt. Ziel ist es, ein Vergütungssystem sicherzustellen, das Fehlanreize zur Eingehung übermäßiger Risiken verhindert. Das Vergütungssystem der HANSAINVEST wird unter Einbeziehung des Risikomanagements und der Compliance Beauftragten mindestens jährlich auf seine Angemessenheit und die Einhaltung der rechtlichen Vorgaben überprüft. Eine Erörterung des Vergütungssystems mit dem Aufsichtsrat findet ebenfalls jährlich statt.

Die Vergütung der Mitarbeiter richtet sich grundsätzlich nach dem Manteltarifvertrag für das Versicherungswesen. Je nach Tätigkeit und Verantwortung erfolgt die Vergütung gemäß der entsprechenden Tarifgruppe. Die Ausgestaltung und Vergütungshöhen der Tarifgruppen werden zwischen Arbeitgeber- und Arbeitnehmerverbänden bzw. der Konzernmutter und den Betriebsräten verhandelt, die HANSAINVEST hat hierauf keinen Einfluss. Nur mit wenigen Mitarbeitern inkl. der leitenden Angestellten sind finanzielle Anreizsysteme für variable Vergütungen und Tantiemen vereinbart. Der Anteil der variablen Vergütung darf dabei maximal 30% der Gesamtvergütung ausmachen. Ein Anreiz, ein unverhältnismäßig großes Risiko für die Gesellschaft einzugehen, resultiert aus der variablen Vergütung nicht.

Die Vergütung für die Geschäftsführer der HANSAINVEST erfolgt auf einzelvertraglicher Basis. Sie setzt sich zusammen aus einer monatlichen festen Vergütung und einer jährlichen Tantieme. Die Höhe der Tantieme wird im gesamten Aufsichtsrat erörtert und festgelegt und orientiert sich nicht am Erfolg der einzelnen Fonds.

Derzeit sind nur die Geschäftsführung als Risikoträger der Gesellschaft eingestuft. Die Gesellschaft überprüft die Vergütungssysteme jährlich. Die Vergütungspolitik der HANSAINVEST erfüllt die Anforderungen des § 37 KAGB, als auch die Leitlinien für solide Vergütungspolitiken unter Berücksichtigung der AIFMD (ESMA/2013/232).

Ergebnisse der jährlichen Überprüfung der Vergütungspolitik

Im Rahmen der internen jährlichen Überprüfung der Einhaltung der Vergütungspolitik ergaben sich keine Anhaltspunkte dafür, dass die Ausgestaltung von fixen und / oder variablen Vergütungen sich nicht an den Regelungen der Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis orientieren.

Angaben zu wesentlichen Änderungen der festgelegten Vergütungspolitik

Keine Änderung im Berichtszeitraum.

Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien

Kapitalverwaltungsgesellschaft:

HANSAINVEST
Hanseatische Investment-Gesellschaft
mit beschränkter Haftung
Postfach 60 09 45
22209 Hamburg
Hausanschrift:
Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Kunden-Servicecenter:
Telefon: (0 40) 3 00 57 - 62 96
Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70
Internet: www.hansainvest.com
E-Mail: service@hansainvest.de

Gezeichnetes Kapital:
€ 10.500.000,00
Eigenmittel:
€ 20.059.012,13
(Stand: 31.12.2019)

Gesellschafter:

SIGNAL IDUNA
Allgemeine Versicherung AG, Dortmund
SIGNAL IDUNA
Lebensversicherung a.G., Hamburg

Verwahrstelle:

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 18.445.196,00
Haftendes Eigenkapital (aufsichtsrecht-
liche Eigenmittel nach Art. 72 CRR):
€ 202.020.403,81
(Stand 31.12.2018)

Einzahlungen:

UniCredit Bank AG, München
(vorm. Bayerische Hypo- und
Vereinsbank)
BIC: HYVEDEMM300
IBAN: DE15200300000000791178

Aufsichtsrat:

Martin Berger (Vorsitzender),
Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA
Gruppe, Hamburg
(zugleich Vorsitzender des Aufsichts-
rates der SIGNAL IDUNA Asset
Management GmbH)

Dr. Karl-Josef Bierth
(stellvertretender Vorsitzender),
Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA
Gruppe, Hamburg

Markus Barth,
Vorsitzender des Vorstandes der
Aramea Asset Management AG,
Hamburg

Dr. Thomas A. Lange,
Vorsitzender des Vorstandes der
National-Bank AG, Essen

Prof. Dr. Harald Stützer,
Geschäftsführender Gesellschafter der
STUETZER Real Estate Consulting
GmbH, Gerolsbach

Prof. Dr. Stephan Schüller,
Kaufmann

Wirtschaftsprüfer:

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Hamburg

Geschäftsführung:

Dr. Jörg W. Stotz
(Sprecher, zugleich Aufsichtsrats-
vorsitzender der HANSAINVEST LUX
S.A., Mitglied der Geschäftsführung
der SIGNAL IDUNA Asset Management
GmbH und der HANSAINVEST Real
Assets GmbH sowie Mitglied des
Aufsichtsrates der Aramea Asset
Management AG)

Nicholas Brinckmann
(zugleich Sprecher der Geschäftsführung
HANSAINVEST Real Assets GmbH)

Andreas Hausladen (ab 01.04.2020)

Ludger Wibbeke
(zugleich stellvertretender Aufsichtsrats-
vorsitzender der HANSAINVEST LUX
S.A. sowie Vorsitzender des
Aufsichtsrates der WohnSelect
Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

HANSAINVEST
Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg
Telefon (040) 3 00 57 - 62 96
Fax (040) 3 00 57 - 60 70

service@hansainvest.de
www.hansainvest.de