

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2020

WALLRICH Prämienstrategie

Luxemburger Investmentfonds gemäß Teil I des Gesetzes vom
17. Dezember 2010 für Organismen für gemeinsame Anlagen
in seiner derzeit gültigen Fassung in der Rechtsform eines
Fonds Commun de Placement (FCP)
R.C.S. Luxembourg K243

HANSAINVEST

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensübersicht WALLRICH Prämienstrategie	3
Geografische Länderaufteilung WALLRICH Prämienstrategie	4
Vermögensaufstellung WALLRICH Prämienstrategie	5
Zu- und Abgänge WALLRICH Prämienstrategie	9
Erläuterungen zum Halbjahresbericht per 30. Juni 2020	11
Verwaltung, Vertrieb und Beratung	14

Zusammensetzung des Fondsvermögens zum 30.06.2020

Fondsvermögen: EUR 14.607.574,12 (24.500.029,31)

Umlaufende Anteile: I-Klasse 57.133 (57.165)

P-Klasse 213.328 (258.551)

R-Klasse 24.273 (42.665)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens per 31.12.2019
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien	2.112	14,46	(17,02)
2. Anleihen	11.202	76,68	(71,13)
3. Sonstige Wertpapiere	1.346	9,22	(9,14)
4. Derivate	-1.075	-7,37	(-1,29)
5. Bankguthaben	985	6,75	(3,58)
6. Sonstige Vermögensgegenstände	100	0,69	(0,60)
II. Verbindlichkeiten			
	-62	-0,43	(-0,18)
III. Fondsvermögen			
	14.608	100,00	

Geografische Länderaufteilung *)

	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Deutschland	3.512.623,00	24,04
Vereinigte Staaten von Amerika	519.772,36	3,56
Frankreich	510.519,64	3,49
Norwegen	498.750,00	3,41
Portugal	60.000,00	0,41
Sonstige	9.558.040,97	65,45
Wertpapiervermögen	14.659.705,97	100,36
Derivate	-1.075.198,27	-7,37
Bankguthaben	985.438,13	6,75
Saldo aus sonstigen Forderungen und Verbindlichkeiten	37.628,29	0,26
	14.607.574,12	100,00

*) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Vermögensaufstellung per 30. Juni 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens	
					im Berichtszeitraum					
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Bayer	DE000BAY0017		STK	3.000	3.000	6.000	EUR 66,900000	200.700,00	1,38	
E.ON SE	DE000ENAG999		STK	50.000	0	50.000	EUR 9,914000	495.700,00	3,39	
RWE	DE0007037129		STK	16.000	16.000	0	EUR 30,730000	491.680,00	3,37	
Volkswagen Vorzugsaktien	DE0007664039		STK	3.000	0	3.500	EUR 134,580000	403.740,00	2,76	
Verzinsliche Wertpapiere										
2,125000000% ADLER Real Estate AG Anleihe v.2017(2017/2024)	XS1731858715		EUR	500	500	0	% 97,009000	485.045,00	3,32	
3,993620000% AXA S.A. EO-FLR MTN 04(09/Und.)	XS0188935174		EUR	300	0	0	% 101,070000	303.210,00	2,08	
2,625000000% Banco Espirito Santo S.A. EO-MTN 14/17	PTBEQKOM0019		EUR	400	0	0	% 15,000000	60.000,00	0,41	
3,125000000% BayWa AG Notes v. 19/24	XS2002496409		EUR	400	200	0	% 102,114500	408.458,00	2,80	
0,375000000% BMW Finance N.V. EO-MTN 18/23	XS1747444245		EUR	500	0	0	% 100,116500	500.582,50	3,43	
1,500000000% Ceske Drahy AS EO-Notes 2019(19/26)	XS1991190361		EUR	500	500	0	% 100,558000	502.790,00	3,44	
1,750000000% CNAC (HK) Finbridge Co. Ltd. EO-Notes 18/22	XS1791704189		EUR	600	0	300	% 99,862500	599.175,00	4,10	
2,375000000% DP World Ltd. EO-MTN 18/26	XS1883878966		EUR	300	300	0	% 97,253500	291.760,50	2,00	
1,698000000% EP Infrastructure a.s. EO-Notes 19/26	XS2034622048		EUR	400	200	0	% 98,703672	394.814,69	2,70	
3,375000000% Eurofins Scientific S.E. EO-Bonds 2015(15/23)	XS1268496640		EUR	400	0	0	% 103,191000	412.764,00	2,83	
2,000000000% Eutelsat S.A. EO-Bonds 18/25	FR0013369493		EUR	500	0	200	% 102,103928	510.519,64	3,49	
1,514000000% Ford Motor Credit Co. LLC EO-MTN 19/23	XS2013574202		EUR	500	0	200	% 94,207500	471.037,50	3,22	
2,500000000% Gaz Capital S.A. EO-M.T.LPN 18(26) GAZPROM	XS1795409082		EUR	500	0	200	% 102,869500	514.347,50	3,52	
0,000000000% Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-Term Nts 2015(25)	XS1269079825		EUR	400	400	0	% 93,731500	374.926,00	2,57	
1,750000000% Hammerson PLC EO-Notes 16/23	XS1379158550		EUR	500	0	200	% 87,242500	436.212,50	2,99	
1,125000000% ING Groep N.V. EO-Med.-Term Nts 2018(25)	XS1771838494		EUR	500	0	500	% 102,912000	514.560,00	3,53	
1,250000000% Molson Coors Brewing Co. EO-Notes 2016(16/24)	XS1440976535		EUR	500	500	0	% 96,899255	484.496,28	3,32	
1,600000000% Mowi ASA EO-FLR Notes 2020(25)	N00010874050		EUR	500	700	200	% 99,750000	498.750,00	3,41	
2,000000000% Nokia OYJ EO-Medium-Term Notes 17(17/24)	XS1577731604		EUR	500	0	200	% 101,946500	509.732,50	3,49	
2,000000000% SIGNIFY N.V. 20/24	XS2128498636		EUR	200	200	0	% 101,307000	202.614,00	1,39	
2,375000000% Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O EO-Med.-Term Cov. Bds 16/21	XS1403416222		EUR	500	0	300	% 99,273000	496.365,00	3,40	
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	10.563.980,61	72,34	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere										
Aktien										
Baidu Inc.	US0567521085		STK	3.000	3.000	0	USD 121,290000	323.569,43	2,22	
Facebook Inc.	US30303M1027		STK	1.000	1.000	0	USD 220,640000	196.202,93	1,34	

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe/ Zugänge		Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum					
Verzinsliche Wertpapiere										
2,500000000% Chengdu Xingch.Inv.Grp Co.Ltd. EO-Bonds 2018(18/21)	XS1748389688		EUR	500	500	0	%	98,565000	492.825,00	3,37
1,250000000% Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2016(16/24)	DE000A189ZX0		EUR	400	0	0	%	103,877000	415.508,00	2,84
0,500000000% Wirecard AG Anleihe v.19/24	DE000A2YNQ58		EUR	800	0	0	%	19,875000	159.000,00	1,09
1,375000000% Bright Food SG Hldgs Pte. Ltd. EO-Notes 19/24	XS2006909407		EUR	500	500	0	%	97,607400	488.037,00	3,34
2,875000000% INEOS Finance PLC EO-Notes 2019(19/26) Reg.S	XS1843437549		EUR	500	500	0	%	95,880000	479.400,00	3,28
2,125000000% PPF Arena 1 B.V. EO-MTN 19/25	XS2078976805		EUR	200	200	0	%	97,444000	194.888,00	1,33
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere								EUR	2.749.430,36	18,81
Investmentanteile										
KVG-eigene Investmentanteile										
Wallrich AI Libero Inhaber-Anteile P	DE000A2DTL29		ANT	9.000	0	5.000	EUR	81,230000	731.070,00	5,00
Wallrich AI Peloton Inhaber-Anteile	DE000A2JQH30		ANT	7.500	0	0	EUR	82,030000	615.225,00	4,21
Summe der Investmentanteile								EUR	1.346.295,00	9,21
Summe Wertpapiervermögen								EUR	14.659.705,97	100,36
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
Derivate auf einzelne Wertpapiere										
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten										
Optionsrechte auf Aktien										
Put Bayer 66,000000000 17.07.2020		XEUR	EUR	-7.500			EUR	1,780000	-13.350,00	-0,09
Put Baidu 110,000000000 21.08.2020		XNYS	USD	-4.000			USD	3,156818	-12.627,27	-0,09
Put Bayer 68,000000000 21.08.2020		XEUR	EUR	-6.000			EUR	4,350000	-26.100,00	-0,18
Put E.ON 10,200000000 21.08.2020		XEUR	EUR	-50.000			EUR	0,580000	-29.000,00	-0,20
Put Volkswagen 150,000000000 21.08.2020		XEUR	EUR	-5.000			EUR	19,550000	-97.750,00	-0,67
Put Lufthansa 14,000000000 18.09.2020		XEUR	EUR	-45.000			EUR	5,360000	-241.200,00	-1,65
Summe der Derivate auf einzelne Wertpapiere								EUR	-420.027,27	-2,88
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten										
Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktienindices										
Put DAX 10500,000000000 21.08.2020		XEUR		Anzahl -30			EUR	170,900000	-25.635,00	-0,18
Put DAX 11000,000000000 21.08.2020		XEUR		Anzahl -30			EUR	244,700000	-36.705,00	-0,25
Put DAX 11300,000000000 21.08.2020		XEUR		Anzahl -30			EUR	301,700000	-45.255,00	-0,31
Put DAX 12700,000000000 17.07.2020		XEUR		Anzahl -30			EUR	596,000000	-89.400,00	-0,61
Put DAX 12500,000000000 18.09.2020		XEUR		Anzahl -26			EUR	815,200000	-105.976,00	-0,73
Put DAX 12700,000000000 21.08.2020		XEUR		Anzahl -40			EUR	797,000000	-159.400,00	-1,09
Put ESTX 50 2925,000000000 21.08.2020		XEUR		Anzahl -50			EUR	61,700000	-30.850,00	-0,21
Put ESTX 50 2950,000000000 21.08.2020		XEUR		Anzahl -50			EUR	66,300000	-33.150,00	-0,23
Put ESTX 50 3200,000000000 21.08.2020		XEUR		Anzahl -50			EUR	134,700000	-67.350,00	-0,46
Put ESTX 50 3300,000000000 17.07.2020		XEUR		Anzahl -50			EUR	122,900000	-61.450,00	-0,42
Summe der Aktienindex-Derivate								EUR	-655.171,00	-4,49

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg			EUR	976.212,51				976.212,51	6,68
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen:									
Verwahrstelle: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg			NOK	6.846,51				627,74	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:									
Verwahrstelle: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg			GBP	3.427,15				3.738,17	0,03
Verwahrstelle: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg			CHF	771,73				722,42	0,00
Verwahrstelle: Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG, Niederlassung Luxemburg			USD	4.652,59				4.137,29	0,04
Summe der Bankguthaben							EUR	985.438,13	6,75
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	69.842,59				69.842,59	0,48
Dividendenansprüche			EUR	30.430,00				30.430,00	0,21
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	100.272,59	0,69
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme									
Kredite in sonstigen EU/EWR-Währungen			DKK	-486,45				-65,27	0,00
Summe der Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-65,27	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-62.579,03			EUR	-62.579,03	-0,43
Fondsvermögen							EUR	14.607.574,12	100 2)
WALLRICH Prämienstrategie I									
Anteilwert							EUR	71,02	
Umlaufende Anteile							STK	57.133	
WALLRICH Prämienstrategie P									
Anteilwert							EUR	45,35	
Umlaufende Anteile							STK	213.328	
WALLRICH Prämienstrategie R									
Anteilwert							EUR	36,08	
Umlaufende Anteile							STK	24.273	

Fußnoten:

1) noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Zinsen laufendes Konto, CSSF-Kosten, Register/Transferstellengebühr, Taxe Abo, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)		per 30.06.2020	
Schweizer Franken	CHF	1,068250	= 1 Euro (EUR)
Dänische Krone	DKK	7,453150	= 1 Euro (EUR)
Britisches Pfund	GBP	0,916800	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	NOK	10,906600	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,124550	= 1 Euro (EUR)
Marktschlüssel			
b) Terminbörsen			
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND		
XNYS	NEW YORK STOCK EXCHANGE, INC.		

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					
ASML Holding	NL0010273215	STK	-	1.400	
Daimler	DE0007100000	STK	-	12.000	
Deutsche Telekom	DE0005557508	STK	18.800	18.800	
ENI	IT0003132476	STK	23.000	23.000	
United Internet	DE0005089031	STK	-	15.000	
Wirecard AG	DE0007472060	STK	-	2.200	
Verzinsliche Wertpapiere					
1,000000000% Realkredit Danmark AS DK-Anl. Serie 10 F per 2025	DK0009295222	DKK	-	3.250	
0,800000000% Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2015(15/23)	BE6276039425	EUR	-	200	
0,625000000% BMW US Capital LLC EO-MTN 15/22	DE000A1ZZ010	EUR	-	700	
0,800000000% Booking Holdings Inc. EO-Notes 17/22	XS1577747782	EUR	-	700	
0,750000000% Daimler AG Medium Term Notes v.16(23)	DE000A169NB4	EUR	-	500	
0,250000000% Daimler Intl Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2018(21)	DE000A194DC1	EUR	-	700	
0,500000000% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35309 v.19(23)	DE000A2LQNY0	EUR	-	1.000	
1,500000000% Deutsche Wohnen SE 2020(2030)	DE000A289NF1	EUR	200	200	
2,875000000% Equinix Inc. EO-Notes 18/24	XS1788558754	EUR	500	500	
1,000000000% HSH Nordbank AG Oster-MarktZins Cap 15(20)	DE000HSH4YE6	EUR	-	509	
1,375000000% Koninklijke Philips N.V. EO-Notes 2020(20/25)	XS2149368529	EUR	250	250	
0,500000000% Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 783 v.17(22)	DE000LB1DVL8	EUR	-	1.500	
2,000000000% Royal Schiphol Group N.V. EO-Medium Term Notes 2020(29)	XS2153459123	EUR	200	200	
1,875000000% International Finance BV EO-Medium-Term Notes 2020(32)	XS2154419118	EUR	200	200	
3,125000000% SoftBank Group Corp. EO-Notes 2017(17/25)	XS1684385161	EUR	300	300	
0,500000000% Volkswagen Leasing GmbH MTN 19/22	XS2014292937	EUR	-	46	
2,250000000% Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2020/30	DE000A28VQD2	EUR	200	200	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,625000000% Deutsche Hypothekenbank MTN-IHS S.473 v.2016(2020)	DE000DHY4739	EUR	-	600	
Zertifikate					
Xetra-Gold	DE000A0S9GB0	STK	5.200	5.200	

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.)					
Optionsrechte					
Wertpapier-Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktien					
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: Deutsche Telekom		EUR			59,59
Verkaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: Wirecard AG		EUR			15,13
Verkaufte Verkaufsoptionen(Put):					
Basiswerte: Deutsche Telekom, E.ON SE, Volkswagen Vorzugsaktien, RWE , SAP , Bayer, Wirecard AG, BASF, Deutsche Lufthansa		EUR			1.577,18
Basiswerte: Baidu Inc., Microsoft Corp., Amazon.com		USD			76,66
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices:					
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswerte: DAX Index, ESTX 50 Index (Price) (EUR)		EUR			3.277,07

WALLRICH Prämienstrategie (der „Fonds“)

Erläuterungen zum Halbjahresbericht zum 30. Juni 2020

1. Allgemeines

Der Fonds ist ein Fonds nach Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen (das „Gesetz von 2010“) und wurde als rechtlich unselbständiges Sondermögen „*fonds commun de placement*“ auf unbestimmte Zeit errichtet. Der Fonds erfüllt die Anforderungen der Richtlinie des Rates der Europäischen Gemeinschaften Nr. 2009/65/EG vom 13. Juli 2009 in seiner jeweils aktuellen Fassung („OGAW-Richtlinie“). Der Fonds wurde als Umbrella-Fonds mit einem oder mehreren Teilfonds errichtet.

Verwaltungsgesellschaft des Fonds ist die HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft mbH, eine Gesellschaft mit beschränkter Haftung nach deutschem Recht mit Sitz in D-22297 Hamburg, Kapstadtring 8 (die „Verwaltungsgesellschaft“). Sie wurde am 2. April 1969 auf unbestimmte Zeit gegründet und ist im Handelsregister des Amtsgerichts Hamburg unter der Registernummer HRB 12891 eingetragen.

Die Verwaltungsgesellschaft ist eine Kapitalverwaltungsgesellschaft im Sinne des deutschen Kapitalanlagegesetzbuches (KAGB). Sie hat der für sie zuständigen Finanzaufsichtsbehörde „Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht“ (BaFin) mit Datum vom 12. Dezember 2017 die Absicht angezeigt, im Großherzogtum Luxemburg die kollektive Vermögensverwaltung von OGAW auszuüben. Mit Datum vom 26. Januar 2018 hat die BaFin der Verwaltungsgesellschaft mitgeteilt, dass sie der CSSF die Absichtsanzeige der Verwaltungsgesellschaft weitergeleitet hat.

2. Wesentliche Buchführungs- und Bewertungsgrundsätze

Dieser Bericht wird in der Verantwortung der Geschäftsführung der Verwaltungsgesellschaft in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Erstellung und Darstellung von Berichten erstellt.

1. Das Netto-Fondsvermögen des Fonds lautet auf Euro (EUR) („Referenzwährung“).
2. Der Wert eines Anteils („Anteilwert“) lautet auf die im jeweiligen Anhang zum Verkaufsprospekt angegebene Währung („Teilfondswährung“), sofern nicht für etwaige weitere Anteilklassen im jeweiligen Anhang zum Verkaufsprospekt eine von der Teilfondswährung abweichende Währung angegeben ist („Anteilklassenwährung“).
3. Der Anteilwert wird von der Verwaltungsgesellschaft oder einem von ihr Beauftragten unter Aufsicht der Verwahrstelle an jedem Bankarbeitstag, der zugleich Börsentag in Luxemburg, Frankfurt am Main und Hamburg ist, mit Ausnahme des 24. und 31. Dezember eines jeden Jahres („Bewertungstag“) berechnet und bis auf zwei Dezimalstellen gerundet. Die Verwaltungsgesellschaft kann für einzelne Teilfonds eine abweichende Regelung treffen, wobei zu berücksichtigen ist, dass der Anteilwert mindestens zweimal im Monat zu berechnen ist. Die Verwaltungsgesellschaft kann jedoch beschließen, den Anteilwert am 24. und 31. Dezember eines Jahres zu ermitteln, ohne dass es sich bei diesen

Wertermittlungen um Berechnungen des Anteilwertes an einem Bewertungstag im Sinne des vorstehenden Satz 1 dieser Ziffer 3 handelt. Folglich können die Anleger keine Ausgabe, Rücknahme und/oder Umtausch von Anteilen auf Grundlage eines am 24. Dezember und/oder 31. Dezember eines Jahres ermittelten Anteilwertes verlangen.

4. Zur Berechnung des Anteilwertes wird der Wert der zu dem jeweiligen Teilfonds gehörenden Vermögenswerte abzüglich der Verbindlichkeiten des jeweiligen Teilfonds („Netto-Teilfondsvermögen“) an jedem Bewertungstag ermittelt und durch die Anzahl der am Bewertungstag im Umlauf befindlichen Anteile des jeweiligen Teilfonds geteilt.
5. Soweit in Jahres- und Halbjahresberichten sowie sonstigen Finanzstatistiken aufgrund gesetzlicher Vorschriften oder gemäß den Regelungen dieses Verwaltungsreglements Auskunft über die Situation des Fondsvermögens des Fonds insgesamt gegeben werden muss, werden die Vermögenswerte des jeweiligen Teilfonds in die Referenzwährung umgerechnet. Das jeweilige Netto-Teilfondsvermögen wird nach folgenden Grundsätzen berechnet:
 - a. Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen, die an einer Wertpapierbörse amtlich notiert sind, werden zum letzten verfügbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, des dem Bewertungstag vorhergehenden Börsentages bewertet.

Die Verwaltungsgesellschaft kann für einzelne Teilfonds festlegen, dass Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen, die an einer Wertpapierbörse amtlich notiert sind, zum letzten verfügbaren Schlusskurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet werden. Dies findet im Anhang der betroffenen Teilfonds Erwähnung.

Soweit Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen an mehreren Wertpapierbörsen amtlich notiert sind, ist die Börse mit der höchsten Liquidität maßgeblich.

- b. Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen, die nicht an einer Wertpapierbörse amtlich notiert sind (oder deren Börsenkurs z.B. aufgrund mangelnder Liquidität als nicht repräsentativ angesehen werden), die aber an einem geregelten Markt gehandelt werden, werden zu einem Kurs bewertet, der nicht geringer als der Geldkurs und nicht höher als der Briefkurs des dem Bewertungstag vorhergehenden Handelstages sein darf und den die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben für den bestmöglichen Kurs hält, zu dem die Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen verkauft werden können.

Die Verwaltungsgesellschaft kann für einzelne Teilfonds festlegen, dass Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen, die nicht an einer Wertpapierbörse amtlich notiert sind (oder deren Börsenkurse z.B. aufgrund mangelnder Liquidität als nicht repräsentativ angesehen wer-

den), die aber an einem geregelten Markt gehandelt werden, zu dem letzten dort verfügbaren Kurs, den die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben für den bestmöglichen Kurs hält, zu dem die Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen verkauft werden können, bewertet werden. Dies findet im Anhang der betroffenen Teilfonds Erwähnung.

- c. OTC-Derivate werden auf einer von der Verwaltungsgesellschaft festzulegenden und überprüfaren Grundlage auf Tagesbasis bewertet.
- d. Anteile an OGAW bzw. OGA werden grundsätzlich zum letzten vor dem Bewertungstag festgestellten Rücknahmepreis angesetzt oder zum letzten verfügbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet. Falls für Investmentanteile die Rücknahmepreise festgelegt werden, werden diese Anteile ebenso wie alle anderen Vermögenswerte zum jeweiligen Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben, allgemein anerkannten und nachprüfaren Bewertungsregeln festlegt.
- e. Falls die jeweiligen Kurse nicht marktgerecht sind, falls die unter b) genannten Finanzinstrumente nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden und falls für andere als die unter Buchstaben a) bis d) genannten Finanzinstrumente keine Kurse festgelegt wurden, werden diese Finanzinstrumente ebenso wie die sonstigen gesetzlich zulässigen Vermögenswerte zum jeweiligen Verkehrswert bewertet, wie ihn die Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben, allgemein anerkannten und nachprüfaren Bewertungsregeln (z. B. geeignete Bewertungsmodelle unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten) festlegt.

sichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten) festlegt.

- f. Die flüssigen Mittel werden zu deren Nennwert zuzüglich Zinsen bewertet.
- g. Forderungen, z. B. abgegrenzte Zinsansprüche und Verbindlichkeiten, werden grundsätzlich zum Nennwert angesetzt.
- h. Der Marktwert von Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten, abgeleiteten Finanzinstrumenten (Derivate) und sonstigen Anlagen, die auf eine andere Währung als die jeweilige Teilfondswährung lauten, wird zu dem unter Zugrundelegung des WM/Reuters-Fixing um 17.00 Uhr (16.00 Uhr Londoner Zeit) ermittelten Devisenkurs des dem Bewertungstag vorhergehenden Börsentages in die entsprechende Teilfondswährung umgerechnet. Gewinne und Verluste aus Devisentransaktionen, werden jeweils hinzugerechnet oder abgesetzt.
- Die Verwaltungsgesellschaft kann für einzelne Teilfonds festlegen, dass Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, abgeleitete Finanzinstrumente (Derivate) sowie sonstige Anlagen, die auf eine andere Währung als die jeweilige Teilfondswährung lauten, zu dem unter Zugrundelegung des am Bewertungstag ermittelten Devisenkurs in die entsprechende Teilfondswährung umgerechnet werden. Gewinne und Verluste aus Devisentransaktionen werden jeweils hinzugerechnet oder abgesetzt. Dies findet im Anhang der betroffenen Teilfonds Erwähnung.

Das jeweilige Netto-Teilfondsvermögen wird um die Ausschüttungen reduziert, die gegebenenfalls an die Anleger des betreffenden Teilfonds gezahlt wurden.

6. Die Anteilwertberechnung erfolgt nach den vorstehend aufgeführten Kriterien für jeden Teilfonds separat. Soweit je-

doch innerhalb eines Teilfonds Anteilsklassen gebildet wurden, erfolgt die daraus resultierende Anteilwertberechnung innerhalb des betreffenden Teilfonds nach den vorstehend aufgeführten Kriterien für jede Anteilklasse getrennt.

Die in diesem Bericht veröffentlichten Tabellen können aus rechnerischen Gründen Rundungsdifferenzen in Höhe von +/- einer Einheit (Währung, Prozent, etc.) enthalten.

3. Besteuerung

Besteuerung des Investmentfonds

Das Fondsvermögen unterliegt im Großherzogtum Luxemburg einer Steuer, der sog. „taxe d'abonnement“ in Höhe von derzeit 0,05% p.a. bzw. 0,01% p.a. für die Teilfonds oder Anteilklassen, deren Anteile ausschließlich an institutionelle Anleger ausgegeben werden. Die „taxe d'abonnement“ ist vierteljährlich auf das jeweils am Quartalsende ausgewiesene Netto-Fondsvermögen zahlbar. Die Höhe der taxe d'abonnement ist für den jeweiligen Teilfonds oder die Anteilklassen im jeweiligen Anhang zum Verkaufsprospekt erwähnt. Soweit das Fondsvermögen in anderen Luxemburger Investmentfonds angelegt ist, die ihrerseits bereits der taxe d'abonnement unterliegen, entfällt diese Steuer für den Teil des Fondsvermögens, welcher in solche Luxemburger Investmentfonds angelegt ist.

Die Einkünfte des jeweiligen Teilfonds aus der Anlage des Fondsvermögens werden im Großherzogtum Luxemburg nicht besteuert. Allerdings können diese Einkünfte in Ländern, in denen das Fondsvermögen angelegt ist, der Quellenbesteuerung unterworfen werden. In solchen Fällen sind weder die Verwahrstelle noch die Verwaltungsgesellschaft zur Einholung von Steuerbescheinigungen verpflichtet.

Besteuerung der Erträge aus Anteilen an dem Investmentfonds beim Anleger

Anleger, die nicht im Großherzogtum Luxemburg ansässig sind, bzw. dort keine Betriebsstätte unterhalten, müssen auf ihre Anteile oder Erträge aus Anteilen im Großherzogtum Luxemburg darüber hinaus weder Einkommen-, Erbschaft-, noch Vermögensteuer entrichten. Für sie gelten die jeweiligen nationalen Steuervorschriften.

Natürliche Personen, mit Wohnsitz im Großherzogtum Luxemburg, die nicht in einem anderen Staat steuerlich ansässig sind, müssen seit dem 1. Januar 2017 unter Bezugnahme auf das Luxemburger Gesetz zur Umsetzung der Richtlinie auf die dort genannten Zinserträge eine abgeltende Quellensteuer in Höhe von 20% zahlen. Diese Quellensteuer kann unter bestimmten Bedingungen auch Zinserträge eines Investmentfonds betreffen.

Interessenten und Anlegern wird empfohlen, sich über Gesetze und Verordnungen, die auf die Besteuerung des Fondsvermögens, den Kauf, den Besitz und die Rücknahme von Anteilen Anwendung finden, zu informieren und sich gegebenenfalls beraten zu lassen.

4. Verwendung der Erträge

Nähere Informationen zur Vertragsverwendung sind für den jeweiligen Teilfonds in dem betreffenden Anhang zum Verkaufsprospekt enthalten.

5. Informationen zu den Gebühren und Aufwendungen

Angaben zu Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren können dem aktuellen Verkaufsprospekt entnommen werden.

6. Ereignisse im Berichtszeitraum

Im Berichtszeitraum ergaben sich keine wesentlichen Änderungen sowie sonstige wesentliche Ereignisse.

7. Ereignisse nach dem Abschlussstichtag

Nach dem Abschlussstichtag ergaben sich keine wesentlichen Änderungen sowie sonstige wesentliche Ereignisse.

8. Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und deren Weiterverwendung

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft mbH, als Verwaltungsgesellschaft für Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) sowie als Manager alternativer Investmentfonds (AIFM), fällt per Definition in den Anwendungsbereich 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).

Im Berichtszeitraum des Fonds kamen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne dieser Verordnung zum Einsatz. Somit sind im vorliegenden Bericht keine Angaben im Sinne von Artikel 13 der genannten Verordnung an die Anleger aufzuführen.

Details zur Anlagestrategie und den eingesetzten Finanzinstrumenten des Fonds können jeweils aus dem aktuellen Verkaufsprospekt entnommen werden.

Verwaltung, Vertrieb und Beratung

Verwaltungsgesellschaft

HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft mbH
Kapstadtring 8
D-22297 Hamburg

Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz
(Sprecher, zugleich Aufsichtsratsvorsitzender 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 Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. sowie Vorsitzender des Aufsichtsrates der WohnSelect Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

Aufsichtsrat

Martin Berger (Vorsitzender),
Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
(zugleich Vorsitzender des Aufsichtsrates 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

Verwahrstelle, Register- und Transferstelle

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

Zahlstelle

Großherzogtum Luxemburg

DZ PRIVATBANK S.A.
4, Rue Thomas Edison
L-1445 Strassen

Deutschland

Fondsinform GmbH
Rudi-Schillings-Str. 9

D-54296 Trier

Fondsmanager

Wallrich Asset Management AG
Bockenheimer Landstraße 64
D-60323 Frankfurt am Main

Anlageberater

Wallrich Asset Management AG
Bockenheimer Landstraße 64
D-60323 Frankfurt am Main

Gebundener Vermittler des Anlageberaters (§ 2 Abs. 10 KWG)

Wallrich Asset Management AG
Bockenheimer Landstraße 64
D-60323 Frankfurt am Main

Abschlussprüfer des Fonds

KPMG Luxembourg,
Société Coopérative
39, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

Abschlussprüfer der Verwaltungsgesellschaft

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Ludwig-Erhard-Straße 11-17
D-20459 Hamburg

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