

Halbjahresbericht zum 31. Juli 2019

Wallrich AI Peloton



WALLRICH

HANSAINVEST

Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie
über die Entwicklung des OGAW-Fonds

Wallrich AI Peloton

in der Zeit vom 1. Februar 2019 bis 31. Juli 2019.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von + 2,78 %.

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

mit herzlichen Grüßen

Ihre
HANSAINVEST-Geschäftsführung

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

Hamburg, im September 2019

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensübersicht per 31. Juli 2019	4
Vermögensaufstellung per 31. Juli 2019	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	9

Vermögensübersicht per 31. Juli 2019

Fondsvermögen: EUR 4.984.181,87 *)

Umlaufende Anteile: 48.495

Vermögensaufteilung in TEUR/%		
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	3.254	65,27
2. Zertifikate	243	4,88
3. Sonstige Wertpapiere	412	8,28
4. Derivate	-32	-0,63
5. Bankguthaben	1.112	22,31
6. Sonstige Vermögensgegenstände	14	0,27
II. Verbindlichkeiten		
	-19	-0,38
III. Fondsvermögen		
	4.984	100,00

*) Auflage am 01.02.2019

Vermögensaufstellung per 31. Juli 2019

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Wbg. in 1.000	Bestand 30.07.2019	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens	
					im Berichtszeitraum					
Börsengehandelte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
3,125000000% BayWa AG Notes v. 19/24	XS2002496409		EUR	150	150	0	% 105,149000	157.723,50	3,16	
0,375000000% BMW Finance N.V. EO-MTN 18/23	XS1747444245		EUR	200	250	50	% 101,882915	203.765,83	4,08	
1,000000000% BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 18/24	XS1808338542		EUR	150	150	0	% 104,268500	156.402,75	3,14	
0,625000000% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	XS1956955980		EUR	100	100	0	% 102,825090	102.825,09	2,06	
0,750000000% Daimler AG Medium Term Notes v.16(23)	DE000A169NB4		EUR	190	250	60	% 103,789500	197.200,05	3,96	
0,500000000% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35309 v.19(23)	DE000A2LQNY0		EUR	200	200	0	% 101,176000	202.352,00	4,06	
2,000000000% Eutelsat S.A. EO-Bonds 18/25	FR0013369493		EUR	100	100	0	% 104,601265	104.601,27	2,09	
1,514000000% Ford Motor Credit Co. LLC EO-MTN 19/23	XS2013574202		EUR	200	200	0	% 101,641125	203.282,25	4,08	
1,500000000% G4S International Finance PLC EO-MTN 16/23	XS1515216650		EUR	150	150	0	% 103,100500	154.650,75	3,10	
1,500000000% Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2018(23)	XS1910851242		EUR	180	200	20	% 104,349000	187.828,20	3,77	
0,500000000% HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. EO-Med.-Term Nts 2018(22/22)	XS1863994981		EUR	150	150	0	% 101,544675	152.317,01	3,06	
2,125000000% Heimstaden Bostad AB EO-Medium-Term Nts 2019(19/23)	XS1958655745		EUR	150	150	0	% 105,216445	157.824,67	3,17	
1,125000000% ING Groep N.V. EO-Med.-Term Nts 2018(25)	XS1771838494		EUR	200	200	0	% 105,068000	210.136,00	4,22	
2,375000000% Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O EO-Med.-Term Cov. Bds 16/21	XS1403416222		EUR	250	250	0	% 99,641000	249.102,50	5,00	
0,500000000% Vodafone Group PLC EO-MTN 16/24	XS1499604905		EUR	150	150	0	% 102,536460	153.804,69	3,09	
0,500000000% Volkswagen Leasing GmbH MTN 19/22	XS2014292937		EUR	300	300	0	% 101,198000	303.594,00	6,08	
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	2.897.410,56	58,12	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere										
Zertifikate										
Xetra-Gold	DE000A0S9GB0		STK	5.900	5.900	0	EUR 41,198000	243.068,20	4,88	
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere							EUR	243.068,20	4,88	
Nicht notierte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
1,698000000% EP Infrastructure a.s. EO-Notes 19/26	XS2034622048		EUR	200	200	0	% 100,865000	201.730,00	4,05	
1,375000000% METRO Wholesale & Food Spec. MTN 14/21	DE000A13R8M3		EUR	150	150	0	% 103,152000	154.728,00	3,10	
Summe der nicht notierten Wertpapiere							EUR	356.458,00	7,15	
Investmentanteile										
KVG-eigene Investmentanteile										
Wallrich Wolf AI Prämienstrat. Inhaber-Anteile	DE000A2DTL29		ANT	3.950	3.950	0	EUR 104,420000	412.459,00	8,28	
Summe der Investmentanteile							EUR	412.459,00	8,28	
Summe Wertpapiervermögen							EUR	3.909.395,76	78,43	

Vermögensaufstellung zum 30.07.2019

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.07.2019	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Optionsrechte									
Optionsrechte auf Aktienindices									
Put ESTX 50 3300,000000000 18.10.2019		XEUR	EUR	Anzahl -14				-5.572,00	-0,11
Put ESTX 50 3250,000000000 20.09.2019		XEUR	EUR	Anzahl -21				-3.738,00	-0,07
Put ESTX 50 3375,000000000 18.10.2019		XEUR	EUR	Anzahl -15				-8.670,00	-0,17
Put ESTX 50 3250,000000000 20.09.2019		XEUR	EUR	Anzahl -16				-2.848,00	-0,06
Put ESTX 50 3350,000000000 18.10.2019		XEUR	EUR	Anzahl -15				-7.650,00	-0,15
Put ESTX 50 3175,000000000 15.11.2019		XEUR	EUR	Anzahl -5				-1.740,00	-0,04
Put ESTX 50 3225,000000000 18.10.2019		XEUR	EUR	Anzahl -5				-1.380,00	-0,03
Summe der Aktienindex-Derivate							EUR	-31.598,00	-0,63
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	711.973,73				711.973,73	14,28
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	400.000,00				400.000,00	8,03
Summe der Bankguthaben							EUR	1.111.973,73	22,31
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	13.629,24				13.629,24	0,27
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	13.629,24	0,27
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-19.218,86			EUR	-19.218,86	-0,38
Fondsvermögen							EUR	4.984.181,87	100 2)
Anteilwert							EUR	102,78	
Umlaufende Anteile							STK	48.495	

Fußnoten:

1) noch nicht abgeführte Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Zinsen laufendes Konto, Performance Fee

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 90,63%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 4.396.033,66 EUR.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Marktschlüssel

a) Wertpapierhandel

Organisierter Markt

b) Terminbörsen

XEUR EUREX DEUTSCHLAND

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					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,875000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-MTN 15/23	XS1167644407	EUR	250	250	
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices:					
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: ESTX 50 Index (Price) (EUR)		EUR			129,95

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 731.697,92

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Donner & Reuschel AG

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	78,43
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,63

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	102,78
Umlaufende Anteile	STK	48.495

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 Aufwandserstattungen. Die KVG gewährt sogenannte Vermittlungsfolgeprovision 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:
Wallrich Wolf AI Prämienstrat. Inhaber-Anteile 0,9500 %

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:
€ 21.729.099,42
(Stand: 31.12.2018)

Gesellschafter:

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

Verwahrstelle:

DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 20.500.000,00
Eigenmittel gem.
Kapitaladäquanzverordnung (CRR):
€ 222.136.245,61
(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

Thomas Gollub,
Berater der Aramea Asset
Management AG, Wedel

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 Wirtschaftsprüfungs-
gesellschaft, Hamburg

Geschäftsführung:

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

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

Ludger Wibbeke (ab 01.07.2019)
(zugleich stellvertretender Aufsichtsrats-
vorsitzender der HANSAINVEST LUX
S.A.)

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