

Halbjahresbericht zum 31. Juli 2020

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 01. Februar 2020 bis 31. Juli 2020.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von - 17,52 %.

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

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

Hamburg, im September 2020

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensübersicht per 31. Juli 2020	4
Vermögensaufstellung per 31. Juli 2020	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	10

Vermögensübersicht per 31. Juli 2020

Fondsvermögen: EUR 8.296.520,36 (10.004.156,54)

Umlaufende Anteile: 97.396 (93.984)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens per 31.01.2020
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien	655	7,89	(4,80)
2. Anleihen	6.298	75,91	(72,20)
3. Zertifikate	212	2,56	(6,69)
4. Sonstige Wertpapiere	653	7,87	(8,11)
5. Derivate	-292	-3,52	(-0,49)
6. Bankguthaben	748	9,01	(8,86)
7. Sonstige Vermögensgegenstände	41	0,49	(0,42)
II. Verbindlichkeiten			
	-18	-0,21	(-0,59)
III. Fondsvermögen			
	8.297	100,00	

Vermögensaufstellung per 31. Juli 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.07.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
E.ON SE	DE000ENAG999		STK	34.500	11.000	0	EUR 10,005000	345.172,50	4,16
RWE	DE0007037129		STK	9.700	2.200	0	EUR 31,910000	309.527,00	3,73
Verzinsliche Wertpapiere									
1,700000000% Altria Group Inc. EO-Notes 19/25	XS1843443513		EUR	300	400	100	% 104,845000	314.535,00	3,79
3,125000000% BayWa AG Notes v. 19/24	XS2002496409		EUR	150	0	0	% 103,512000	155.268,00	1,87
0,875000000% CEZ AS EO-Medium-Term Notes 2019(26)	XS2084418339		EUR	300	400	100	% 101,137950	303.413,85	3,66
0,750000000% CK Hutchison Grp Tele.Fin. SA EO-Notes 2019(26/26)	XS2057069093		EUR	300	400	100	% 100,402500	301.207,50	3,63
1,750000000% CNAC (HK) Finbridge Co. Ltd. EO-Notes 18/22	XS1791704189		EUR	100	100	0	% 100,931900	100.931,90	1,22
0,500000000% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35309 v.19(23)	DE000A2LQNY0		EUR	200	0	0	% 100,239500	200.479,00	2,42
1,698000000% EP Infrastructure a.s. EO-Notes 19/26	XS2034622048		EUR	200	300	300	% 100,349830	200.699,66	2,42
2,000000000% Eutelsat S.A. EO-Bonds 18/25	FR0013369493		EUR	100	0	0	% 104,343500	104.343,50	1,26
1,514000000% Ford Motor Credit Co. LLC EO-MTN 19/23	XS2013574202		EUR	100	0	100	% 97,144500	97.144,50	1,17
1,500000000% G4S International Finance PLC EO-MTN 16/23	XS1515216650		EUR	150	0	0	% 101,269000	151.903,50	1,83
2,500000000% Gaz Capital S.A. EO-M.T.LPN 18(26) GAZPROM	XS1795409082		EUR	200	0	0	% 102,196750	204.393,50	2,46
1,500000000% Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2018(23)	XS1910851242		EUR	180	0	0	% 101,379000	182.482,20	2,20
1,750000000% Hammerson PLC EO-Notes 16/23	XS1379158550		EUR	200	200	0	% 87,573333	175.146,67	2,11
2,125000000% Heimstaden Bostad AB EO-Medium-Term Nts 2019(19/23)	XS1958655745		EUR	150	0	0	% 103,178760	154.768,14	1,87
3,250000000% Hornbach-Baumarkt AG 19/26	DE000A255DH9		EUR	200	0	0	% 103,253000	206.506,00	2,49
1,600000000% Mowi ASA EO-FLR Notes 2020(25)	NO0010874050		EUR	200	0	0	% 99,996000	199.992,00	2,41
0,125000000% Nykredit Realkredit A/S EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	DK0009525404		EUR	100	100	0	% 97,764966	97.764,97	1,18
1,250000000% PartnerRe Ireland Finance DAC EO-Notes 2016(26)	XS1489391109		EUR	300	400	100	% 103,260701	309.782,10	3,73
1,250000000% Renault S.A. EO-Med.-Term Notes 2019(19/25)	FR0013428414		EUR	300	300	0	% 92,536000	277.608,00	3,35
0,125000000% Scania CV AB EO-MTN 20/23	XS2117485248		EUR	100	100	0	% 98,504000	98.504,00	1,19
2,750000000% Sydney Airport Fin.Co.Pty Ltd. EO-MTN14/24	XS1057783174		EUR	200	200	0	% 106,258290	212.516,58	2,56
2,375000000% Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O EO-Med.-Term Cov. Bds 16/21	XS1403416222		EUR	200	0	250	% 99,345500	198.691,00	2,39
2,500000000% Unibail-Rodamco SE EO-MTN 14/24	XS1038708522		EUR	150	150	0	% 105,648262	158.472,39	1,91
1,625000000% Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.18(25)	XS1865186677		EUR	400	400	0	% 103,741009	414.964,04	5,00
0,452000000% Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/23)	XS2054209320		EUR	300	0	0	% 99,068450	297.205,35	3,58
0,410000000% Ford Motor Credit Co. LLC EO-FLR Med. Term Nts 2017(24)	XS1729872736		EUR	100	0	0	% 87,943000	87.943,00	1,06
0,000000000% ITV PLC EO-Notes 2019(19/26)	XS2050543839		EUR	300	200	200	% 98,114500	294.343,50	3,55
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	6.155.709,35	74,20

Vermögensaufstellung zum 30.07.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.07.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens	
					im Berichtszeitraum					
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
0,625000000% Glencore Finance Europe S.A. EO-MTN 19/24	XS2051397961		EUR	200	0	0	% 98,970500	197.941,00	2,39	
0,500000000% Wirecard AG Anleihe v.19/24	DE000A2YNQ58		EUR	400	0	0	% 13,020000	52.080,00	0,63	
Zertifikate										
Xetra-Gold	DE000A0S9GB0		STK	4.000	5.500	16.000	EUR 53,075000	212.300,00	2,56	
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere								EUR	462.321,00	5,58
Nicht notierte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
4,350000000% Fortune Star (BVI) Ltd. EO-Notes 2019(23)	XS2066225124		EUR	300	0	0	% 98,187500	294.562,50	3,55	
1,625000000% Rail Transit Int.Invst.Co.Ltd. EO-Notes 2018(22)	XS1679505070		EUR	250	0	0	% 100,849000	252.122,50	3,04	
Summe der nicht notierten Wertpapiere								EUR	546.685,00	6,59
Investmentanteile										
KVG-eigene Investmentanteile										
Wallrich AI Libero Inhaber-Anteile P	DE000A2DTL29		ANT	7.750	0	0	EUR 84,280000	653.170,00	7,86	
Summe der Investmentanteile								EUR	653.170,00	7,86
Summe Wertpapiervermögen								EUR	7.817.885,35	94,23
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten										
Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktienindices										
Put ESTX 50 3250,000000000 21.08.2020		XEUR	STK	-14			EUR 104,200000	-14.588,00	-0,18	
Put ESTX 50 3350,000000000 21.08.2020		XEUR	STK	-34			EUR 171,300000	-58.242,00	-0,70	
Put ESTX 50 3175,000000000 18.09.2020		XEUR	STK	-29			EUR 109,600000	-31.784,00	-0,38	
Put ESTX 50 3200,000000000 21.08.2020		XEUR	STK	-180			EUR 79,900000	-143.820,00	-1,73	
Put ESTX 50 3225,000000000 21.08.2020		XEUR	STK	-27			EUR 91,300000	-24.651,00	-0,30	
Put ESTX 50 3200,000000000 21.08.2020		XEUR	STK	-24			EUR 79,900000	-19.176,00	-0,23	
Put ESTX 50 3225,000000000 18.10.2019		XEUR	EUR	Anzahl -5				-1.380,00	-0,03	
Summe der Aktienindex-Derivate								EUR	-292.261,00	-3,52
Bankguthaben										
EUR - Guthaben bei:										
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	747.521,06				747.521,06	9,01	
Summe der Bankguthaben								EUR	747.521,06	9,01
Sonstige Vermögensgegenstände										
Zinsansprüche			EUR	41.006,90				41.006,90	0,49	
Summe sonstige Vermögensgegenstände								EUR	41.006,90	0,49
Sonstige Verbindlichkeiten 1)								EUR	-17.631,95	-0,21
Fondsvermögen								EUR	8.296.520,36	100 2)
Anteilwert								EUR	85,18	
Umlaufende Anteile								STK	97.396	

Fußnoten:

- 1) noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, Zinsen laufendes Konto
- 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 99,96 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 14.696.911,31 EUR.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Marktschlüssel

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					
1,300000000% Baxter International Inc. EO-Notes 2017(17/25)	XS1577962084	EUR	-	300	
0,000000000% Eximbank of China (Macau Br.) EO-Medium-Term Nts 2019(21)	XS2060692873	EUR	-	300	
0,375000000% BMW Finance N.V. EO-MTN 18/23	XS1747444245	EUR	-	200	
1,000000000% BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 18/24	XS1808338542	EUR	-	150	
0,375000000% CK Hutchison Grp Tele.Fin. SA EO-Notes 19/23	XS2056572154	EUR	-	200	
0,625000000% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(24)	XS1956955980	EUR	-	100	
0,750000000% Daimler AG Medium Term Notes v.16(23)	DE000A169NB4	EUR	-	190	
0,500000000% HeidelbergCement Fin.Lux. S.A. EO-Med.-Term Nts 2018(22/22)	XS1863994981	EUR	-	150	
1,125000000% ING Groep N.V. EO-Med.-Term Nts 2018(25)	XS1771838494	EUR	-	200	
1,375000000% METRO Wholesale & Food Spec. MTN 14/21	DE000A13R8M3	EUR	-	150	
0,500000000% Volkswagen Leasing GmbH MTN 19/22	XS2014292937	EUR	-	300	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
1,250000000% Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2016(16/24)	DE000A189ZX0	EUR	-	300	
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			2.158,89

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 5.293.955,89

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 %)	94,23
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-3,52

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	85,18
Umlaufende Anteile	STK	97.396

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 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 AI Libero Inhaber-Anteile P	0,9500 %
--------------------------------------	----------

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:

DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 24.100.000,00
Eigenmittel gem.
Kapitaladäquanzverordnung (CRR):
€ 267.959.000,00
(Stand: 31.12.2019)

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