

Halbjahresbericht zum 31. Juli 2021

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 2021 bis 31. Juli 2021.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von + 6,24 %.

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, Ludger Wibbeke

Hamburg, im September 2021

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensübersicht per 31. Juli 2021	4
Vermögensaufstellung per 31. Juli 2021	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	10

Vermögensübersicht per 31. Juli 2021

Fondsvermögen: EUR 9.291.772,64 (8.955.711,99)

Umlaufende Anteile: 94.261 (95.509)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens per 31.01.2021
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien	0	0,00	(4,93)
2. Anleihen	2.591	27,88	(42,29)
3. Zertifikate	0	0,00	(1,65)
4. Sonstige Wertpapiere	728	7,84	(7,73)
5. Derivate	-45	-0,49	(-1,13)
6. Bankguthaben	6.027	64,86	(44,39)
7. Sonstige Vermögensgegenstände	10	0,11	(0,34)
II. Verbindlichkeiten			
	-19	-0,20	(-0,20)
III. Fondsvermögen			
	9.292	100,00	

Vermögensaufstellung per 31. Juli 2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2021	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
3,125000000% BayWa AG Notes v. 19/24	XS2002496409		EUR	150	0	0	% 107,104000	160.656,00	1,73
1,875000000% CA Immobilien Anlagen AG EO-Anl. 2017(24)	AT0000A1TBC2		EUR	200	200	0	% 103,431000	206.862,00	2,23
0,500000000% Deutsche Pfandbriefbank AG MTN R.35309 v.19(23)	DE000A2LQNY0		EUR	200	0	0	% 100,549500	201.099,00	2,16
1,514000000% Ford Motor Credit Co. LLC EO-MTN 19/23	XS2013574202		EUR	100	0	0	% 101,705500	101.705,50	1,09
1,625000000% Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG IHS v. 20/24	XS2198798659		EUR	200	200	0	% 103,745500	207.491,00	2,23
1,500000000% Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2018(23)	XS1910851242		EUR	100	0	150	% 98,606000	98.606,00	1,06
2,750000000% Lagardère S.C.A. EO-Obl. 2016(16/23)	FR0013153160		EUR	100	100	0	% 102,804000	102.804,00	1,11
3,000000000% LUFTHANSA AG 20/26	XS2265369657		EUR	200	0	0	% 101,412000	202.824,00	2,18
1,600000000% Mowi ASA EO-FLR Notes 2020(25)	N00010874050		EUR	200	0	0	% 102,806000	205.612,00	2,21
1,875000000% Otto (GmbH & Co KG) MTN v.17/24	XS1625975153		EUR	100	100	0	% 104,037500	104.037,50	1,12
1,250000000% Renault S.A. EO-Med.-Term Notes 2019(19/25)	FR0013428414		EUR	200	0	0	% 99,336000	198.672,00	2,14
0,125000000% Scania CV AB EO-MTN 20/23	XS2117485248		EUR	100	0	0	% 100,534000	100.534,00	1,08
1,750000000% Sixt SE Anleihe v.2020/2024	DE000A3H2UX0		EUR	100	100	0	% 103,720000	103.720,00	1,12
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	1.994.623,00	21,46
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
0,250000000% Deutsche Lufthansa AG MTN v. 19/24	XS2049726990		EUR	100	0	0	% 97,013000	97.013,00	1,04
1,500000000% Iliad S.A. EO-Obl. 2017(17/24)	FR0013287273		EUR	100	100	0	% 101,876000	101.876,00	1,10
0,500000000% Wirecard AG Anleihe v.19/24	DE000A2YNQ58		EUR	400	0	0	% 12,260000	49.040,00	0,53
0,157000000% Ford Motor Credit Co. LLC EO-FLR Med. Term Nts 2017(24)	XS1729872736		EUR	100	0	0	% 97,814000	97.814,00	1,05
1,625000000% Rail Transit Int.Invst.Co.Ltd. EO-Notes 2018(22)	XS1679505070		EUR	250	0	0	% 100,277700	250.694,25	2,70
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere							EUR	596.437,25	6,42
Investmentanteile									
KVG-eigene Investmentanteile									
Wallrich AI Libero Inhaber-Anteile P	DE000A2DTL29		ANT	7.750	0	0	EUR 93,950000	728.112,50	7,84
Summe der Investmentanteile							EUR	728.112,50	7,84
Summe Wertpapiervermögen							EUR	3.319.172,75	35,72

Vermögensaufstellung zum 31.07.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.07.2021	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 auf Aktienindices									
Put ESTX 50 3825,000000000 20.08.2021		XEUR		Anzahl -49			EUR 11,400000	-5.586,00	-0,06
Put ESTX 50 3850,000000000 20.08.2021		XEUR		Anzahl -115			EUR 12,800000	-14.720,00	-0,16
Put ESTX 50 3850,000000000 20.08.2021		XEUR		Anzahl -114			EUR 12,800000	-14.592,00	-0,16
Put ESTX 50 3825,000000000 20.08.2021		XEUR		Anzahl -13			EUR 11,400000	-1.482,00	-0,02
Put ESTX 50 3850,000000000 17.09.2021		XEUR		Anzahl -24			EUR 35,500000	-8.520,00	-0,09
Summe der Aktienindex-Derivate							EUR	-44.900,00	-0,49
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	1.805.373,45				1.805.373,45	19,43
Bank: Hamburger Volksbank			EUR	799.887,50				799.887,50	8,61
Bank: National-Bank AG			EUR	1.695.119,20				1.695.119,20	18,24
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	1.726.264,43				1.726.264,43	18,58
Summe der Bankguthaben							EUR	6.026.644,58	64,86
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	9.861,56				9.861,56	0,11
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	9.861,56	0,11
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-19.006,25			EUR	-19.006,25	-0,20
Fondsvermögen							EUR	9.291.772,64	100 2)
Anteilwert							EUR	98,57	
Umlaufende Anteile							STK	94.261	

Fußnoten:

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

2) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen 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 100,00 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 4.761.227,87 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					
Aktien					
Bayer	DE000BAY0017	STK	4.100	4.100	
RWE	DE0007037129	STK	-	9.700	
Volkswagen Vorzugsaktien	DE0007664039	STK	-	600	
Verzinsliche Wertpapiere					
1,750000000% CNAC (HK) Finbridge Co. Ltd. EO-Notes 18/22	XS1791704189	EUR	-	100	
1,698000000% EP Infrastructure a.s. EO-Notes 19/26	XS2034622048	EUR	-	200	
1,375000000% Euronet Worldwide Inc. DL-Exch. Notes 2019(26)	XS2001315766	EUR	-	150	
1,625000000% Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG IHS v. 21/24	XS2324722607	EUR	200	200	
1,500000000% G4S International Finance PLC EO-MTN 16/23	XS1515216650	EUR	-	150	
2,500000000% Gaz Capital S.A. EO-M.T.LPN 18(26) GAZPROM	XS1795409082	EUR	-	200	
1,750000000% Hammerson PLC EO-Notes 16/23	XS1379158550	EUR	-	200	
1,500000000% HEATHR.FUND 20/25	XS2242979719	EUR	-	100	
2,375000000% Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O EO-Med.-Term Cov. Bds 16/21	XS1403416222	EUR	-	200	
0,452000000% Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/23)	XS2054209320	EUR	-	300	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
4,350000000% Fortune Star (BVI) Ltd. EO-Notes 2019(23)	XS2066225124	EUR	-	300	
Zertifikate					
Xetra-Gold	DE000A0S9GB0	STK	-	3.000	
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:					
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: ESTX 50 Index (Price) (EUR)		EUR			746,95

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 1.491.251,77

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 %)	35,72
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,49

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	98,57
Umlaufende Anteile	STK	94.261

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:
€ 15.743.950,10
(Stand: 31.12.2020)

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):
€ 277.285.859,14
(Stand: 31.12.2020)

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 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 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)

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