

Halbjahresbericht zum 31. Mai 2018

Wallrich Wolf AI Prämienstrategie



Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Wallrich Wolf AI Prämienstrategie

in der Zeit vom 01. Dezember 2017 bis 31. Mai 2018.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von - 0,07 %.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Investmentvermögens im Detail per Ende Mai darstellte. Im Rahmen des nächsten Jahresberichtes erhalten Sie zudem einen umfangreichen Marktbericht. Abseits dessen stehen wir Ihnen aber auch für weitere Fragen gern zur Verfügung und verbleiben

mit herzlichen Grüßen

Ihre
HANSAINVEST-Geschäftsführung

Nicholas Brinckmann, Marc Drießen, Dr. Jörg W. Stotz

Hamburg, im Juni 2018

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensaufstellung per 31. Mai 2018	4
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	8
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	9

Vermögensaufstellung per 31. Mai 2018

Fondsvermögen: EUR 8.024.712,41

Umlaufende Anteile: 80.304

Vermögensaufteilung in TEUR/%		
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände		
1. Anleihen	4.653	57,99
2. Derivate	-20	-0,25
3. Bankguthaben	3.393	42,28
4. Sonstige Vermögensgegenstände	12	0,15
II. Verbindlichkeiten		
	-13	-0,17
III. Fondsvermögen		
	8.025	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.05.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2018	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
0,235000000% ABN AMRO Bank N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 2000(20)	XS0114072423		EUR	100	100	0	% 99,353500	99.353,50	1,24
1,300000000% AT & T Inc. EO-Notes 2015(15/23)	XS1196373507		EUR	200	200	0	% 102,566485	205.132,97	2,56
0,750000000% Bank of America Corp. EO-Medium-Term Nts 2016(16/23)	XS1458405898		EUR	150	150	0	% 99,139615	148.709,42	1,85
0,750000000% Berkshire Hathaway Inc. EO-Notes 2015(15/23)	XS1200670955		EUR	300	300	0	% 101,380325	304.140,98	3,79
0,500000000% British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/22)	XS1637332856		EUR	200	200	0	% 100,008500	200.017,00	2,49
0,500000000% China Development Bank EO-Medium-Term Notes 2016(21)	XS1422314689		EUR	100	100	0	% 100,607000	100.607,00	1,25
0,750000000% Citigroup Inc. EO-MMTN 16/23	XS1457608013		EUR	100	100	0	% 98,552000	98.552,00	1,23
0,875000000% CK Hutchison Fin. (16) II Ltd. EO-Notes 2016(24)	XS1497312295		EUR	100	100	0	% 99,233875	99.233,88	1,24
1,750000000% CNAC (HK) Finbridge Co. Ltd. EO-Notes 18/22	XS1791704189		EUR	100	100	0	% 100,672500	100.672,50	1,25
0,572000000% DVB Bank SE FLR-MTN v.2017(20)	XS1562586955		EUR	100	100	0	% 100,549500	100.549,50	1,25
0,500000000% Export-Import Bk of Korea, The EO-Medium-Term Notes 2017(22)	XS1619861864		EUR	100	100	0	% 100,248500	100.248,50	1,25
1,500000000% Kraft Heinz Foods Co. EO-Notes 16/24	XS1405782407		EUR	200	200	0	% 101,736000	203.472,00	2,54
0,500000000% Landesbank Baden-Württemberg MTN Serie 783 v.17(22)	DE000LB1DVL8		EUR	300	300	0	% 100,519500	301.558,50	3,76
1,000000000% McDonald's Corp. EO-Medium-Term Nts 2016(23)	XS1403264374		EUR	100	100	0	% 101,663810	101.663,81	1,27
0,000000000% National Bank of Canada EO-Med.-Term Cov. Bds 2016(23)	XS1496770626		EUR	200	200	0	% 98,215500	196.431,00	2,45
0,673000000% Norddeutsche Landesbank -GZ- FLR-Inh.-Schw. v.16(19)	DE000NLB86H7		EUR	200	200	0	% 100,892500	201.785,00	2,51
0,250000000% Pfizer Inc. EO-Notes 17/22	XS1574157357		EUR	200	200	0	% 100,434385	200.868,77	2,50
0,800000000% Priceline Group Inc., The EO-Notes 2017(17/22)	XS1577747782		EUR	100	100	0	% 101,184765	101.184,77	1,26
0,000000000% Sanofi S.A. EO-MTN 16/22	FR0013201621		EUR	200	200	0	% 99,237755	198.475,51	2,47
0,250000000% Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2016(16/24)	FR0013201308		EUR	100	100	0	% 96,560365	96.560,37	1,20
0,500000000% Société Générale S.A. EO-Medium-Term Notes 2017(23)	XS1718306050		EUR	100	100	0	% 97,279735	97.279,74	1,21
0,250000000% Total Capital Intl S.A. EO-Medium-Term Notes 2016(23)	XS1443997223		EUR	200	200	0	% 99,268500	198.537,00	2,47
0,375000000% United Parcel Service Inc. EO-Notes 2017(17/23)	XS1718480327		EUR	100	100	0	% 99,130300	99.130,30	1,24
0,314000000% Veolia Environnement S.A. EO-MTN 16/23	FR0013210408		EUR	100	100	0	% 98,567915	98.567,92	1,23
0,500000000% Vodafone Group PLC EO-MTN 16/24	XS1499604905		EUR	100	100	0	% 97,681275	97.681,28	1,22
0,093000000% Volkswagen Bank GmbH FLR-MTN 17/21	XS1734547919		EUR	100	100	0	% 99,859000	99.859,00	1,25
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	3.850.272,22	47,98
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
0,424000000% Danone S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/22)	FR0013216900		EUR	200	200	0	% 100,570085	201.140,17	2,51
0,625000000% Deutsche Hypothekbank MTN-IHS S.473 v.2016(2020)	DE000DHY4739		EUR	100	100	0	% 100,735000	100.735,00	1,26
0,500000000% Lb.Hessen-Thüringen GZ IHS E0514B/220 v.15(21)	DE000HLB4PU3		EUR	200	200	0	% 100,770000	201.540,00	2,51
0,372000000% Ford Motor Credit Co. LLC EO-FLR Med. Term Nts 2017(24)	XS1729872736		EUR	200	200	0	% 99,279500	198.559,00	2,47
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere							EUR	701.974,17	8,75

Vermögensaufstellung zum 31.05.2018

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.05.2018	Käufe/ Zugänge		Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum					
Nicht notierte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
0,800000000% Kellogg Co. EO-Notes 17/22	XS1611042646		EUR	100	100	0	%	101,284760	101.284,76	1,26
Summe der nicht notierten Wertpapiere								EUR	101.284,76	1,26
Summe Wertpapiervermögen								EUR	4.653.531,15	57,99
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten										
Optionsrechte										
Optionsrechte auf Aktienindices										
Put ESTX 50 2925,000000000 15.06.2018	DE0009652396		STK	-48					-816,00	-0,01
Put ESTX 50 3025,000000000 15.06.2018	DE0009652396		STK	-48					-1.296,00	-0,02
Put ESTX 50 3075,000000000 20.07.2018	DE0009652396		STK	-110					-15.950,00	-0,20
Put ESTX 50 3100,000000000 20.07.2018	DE0009652396		STK	-13					-2.106,00	-0,02
Summe der Aktienindex-Derivate								EUR	-20.168,00	-0,25
Bankguthaben										
EUR - Guthaben bei:										
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	1.590.732,70					1.590.732,70	19,82
Bank: National-Bank AG			EUR	200.000,00					200.000,00	2,49
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	1.602.000,00					1.602.000,00	19,97
Summe der Bankguthaben								EUR	3.392.732,70	42,28
Sonstige Vermögensgegenstände										
Zinsansprüche			EUR	11.869,71					11.869,71	0,15
Summe sonstige Vermögensgegenstände								EUR	11.869,71	0,15
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-13.253,15			EUR		-13.253,15	-0,17
Fondsvermögen								EUR	8.024.712,41	100*)
Anteilwert								EUR	99,93	
Umlaufende Anteile								STK	80.304	

Fußnoten:

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

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

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Investmentvermögens über Broker ausgeführt wurden, die verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 98,43%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 12.544.207,00 EUR.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Investmentvermögens 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
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Wertpapier-Terminkontrakte					
Wertpapier-Terminkontrakte auf Renten					
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: Bundesrep. Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe		EUR			3.977,62
Optionsrechte					
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate					
Optionsrechte auf Aktienindices:					
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: DJES 50 Index (Price) (EUR)		EUR			73,68

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 506.598,23

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

Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

Donner & Reuschel AG

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	57,99
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,25

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	99,93
Umlaufende Anteile	STK	80.304

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung von Vermögenswerten, die an einer Börse zum amtlichen Markt zugelassen bzw. in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind, erfolgt zu den handelbaren Schlusskursen des vorhergehenden Börsentages gem. § 27 KARBV. Nicht notierte Rentenwerte und Schuldscheindarlehen werden mit Renditekursen bewertet. Investmentzertifikate 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).

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Investmentvermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen.

Die KVG gewährt sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Investmentvermögen an sie geleisteten Vergütung.

Angaben zur Mitarbeitervergütung der HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH (KVG) für das Geschäftsjahr 2017

Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten Mitarbeitervergütung (inkl. Geschäftsführer):	EUR	9.668.504,18
davon fix:	EUR	7.731.706,47
davon variabel:	EUR	1.936.797,71
Zahl der Mitarbeiter der KVG: 128		
Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr 2017 der KVG gezahlten Vergütung an Risktaker (nur Führungskräfte):	EUR	878.912,52

Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien

Kapitalverwaltungsgesellschaft:

HANSAINVEST
Hanseatische Investment-GmbH
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.de
E-Mail: service@hansainvest.de

Gezeichnetes Kapital:
10.500 TEUR
Eigenmittel:
14.154 TEUR
(Stand: 31.12.2017)

Gesellschafter:

SIGNAL IDUNA
Allgemeine Versicherung AG, Dortmund
IDUNA Vereinigte Lebensversicherung
aG für Handwerk, Handel und Gewerbe,
Hamburg

Verwahrstelle:

Hauck & Aufhäuser Privatbankiers AG
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital:
€ 16.000.000,00
Haftendes Eigenkapital (anrechenbare
Eigenmittel nach Art. 72 CRR):
€ 160.251.597,01
(Stand 31.12.2017)

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:

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft,
Hamburg

Geschäftsführung:

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

Marc Drießen
(zugleich stellvertretender Präsident
des Verwaltungsrats der HANSAINVEST
LUX S.A.)

Dr. Jörg W. Stotz
(zugleich Präsident des Verwaltungsrats
der HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied
der Geschäftsführung der SIGNAL
IDUNA Asset Management GmbH
sowie Mitglied der Geschäftsführung
HANSAINVEST Real Assets GmbH)

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