

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

HALBJAHRESBERICHT

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsfonds

31. Dezember 2021

HANSAINVEST

**SEHR GEEHRTE ANLEGERIN,
SEHR GEEHRTER ANLEGER,**

Hamburg, im Februar 2022

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

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsfonds

in der Zeit vom 01. Juli 2021 bis 31. Dezember 2021.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von - 0,06 % in der Klasse P und von + 0,21 % in der Klasse SBA.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Sondervermögens im Detail per Ende Dezember darstellte. Wenn Sie darüber hinaus einen aktuellen Einblick in den Fonds bekommen und unsere Einschätzung der Märkte kennenlernen möchten, besuchen Sie unseren Internetauftritt: Unter www.hansainvest.de veröffentlichen wir regelmäßig einen Kommentar des Fondsmanagements. 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

SO BEHALTEN SIE DEN ÜBERBLICK

VERMÖGENSÜBERSICHT ZUM 31. DEZEMBER 2021	4
VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31. DEZEMBER 2021	5
ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV	8
KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT, VERWAHRSTELLE UND GREMIEN	9

VERMÖGENSÜBERSICHT ZUM 31. DEZEMBER 2021

Fondsvermögen:	EUR 6.568.868,79	(6.310.980,81)
Umlaufende Anteile: (P)-Klasse	21.231	(21.776)
(SBA)-Klasse	48.749	(44.609)

VERMÖGENSAUFTEILUNG IN TEUR/%

	Kurswert in Fondswährung	% des Fondsvermögens	% des Fondsvermögens per 30.06.2021
I. Vermögensgegenstände			
1. Aktien	4.133	62,90	(58,12)
2. Anleihen	1.729	26,32	(30,87)
3. Zertifikate	102	1,56	(1,51)
4. Sonstige Wertpapiere	521	7,93	(7,26)
5. Derivate	-117	-1,78	(0,04)
6. Bankguthaben	201	3,06	(1,68)
7. Sonstige Vermögensgegenstände	29	0,44	(0,79)
II. Verbindlichkeiten	-29	-0,43	(-0,27)
III. Fondsvermögen	6.569	100,00	

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 31. DEZEMBER 2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens	
					im Berichtszeitraum					
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Allianz	DE0008404005		STK	1.395	0	0	EUR	208,100000	290.299,50	4,41
Eiffage	FR0000130452		STK	2.000	0	0	EUR	90,320000	180.640,00	2,74
Gerresheimer	DE000A0LD6E6		STK	1.371	0	0	EUR	84,400000	115.712,40	1,75
Hannover Rück SE	DE0008402215		STK	1.270	0	0	EUR	167,550000	212.788,50	3,24
KONE	FI0009013403		STK	2.500	2.500	0	EUR	63,280000	158.200,00	2,41
LEG Immobilien	DE000LEG1110		STK	2.000	0	0	EUR	122,350000	244.700,00	3,73
NN Group	NL0010773842		STK	6.000	0	0	EUR	48,000000	288.000,00	4,38
Red Electrica Corporacion	ES0173093024		STK	8.600	0	0	EUR	19,010000	163.486,00	2,49
UnipolSai	IT0004827447		STK	75.000	0	0	EUR	2,478000	185.850,00	2,83
UPM Kymmene Corp.	FI0009005987		STK	4.000	0	0	EUR	33,420000	133.680,00	2,04
IA Financial Corporation Inc.	CA45075E1043		STK	2.000	2.000	0	CAD	72,440000	99.714,37	1,52
Adecco Group AG	CH0012138605		STK	2.500	0	0	CHF	46,610000	112.394,50	1,71
Helvetia Holding AG Namens-Aktien SF 0,02	CH0466642201		STK	2.000	0	0	CHF	107,900000	208.150,47	3,17
Swiss Life	CH0014852781		STK	400	0	230	CHF	562,800000	217.140,10	3,31
Dali Foods Group Co. Ltd. Registered Shares HD -,01	KYG2743Y1061		STK	380.000	0	0	HKD	4,180000	179.504,57	2,73
Hengan Internat. Grp	KYG4402L1510		STK	37.000	0	0	HKD	41,150000	172.062,88	2,62
Shimao Property Holdings	KYG810431042		STK	80.000	0	0	HKD	5,210000	47.102,43	0,72
NKSJ Holdings	JP3165000005		STK	6.000	0	0	JPY	4.865,000000	223.703,87	3,41
T & D	JP3539220008		STK	18.000	0	0	JPY	1.476,000000	203.609,61	3,10
Tokio Marine Holdings	JP3910660004		STK	2.500	0	0	JPY	6.403,000000	122.676,94	1,87
Orkla	NO0003733800		STK	15.000	0	0	NOK	88,280000	132.897,77	2,02
First Horizon National	US3205171057		STK	16.000	16.000	0	USD	16,450000	231.914,71	3,53
Verzinsliche Wertpapiere										
3,500000000% DIC Asset AG Inh.-Schuldv v.2018(2021/2023)	DE000A2NBZG9		EUR	292	0	0	%	102,594000	299.574,48	4,56
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	4.223.803,10	64,29	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere										
Aktien										
Great-West Lifeco Inc. Registered Shares o.N.	CA39138C1068		STK	8.000	8.000	0	CAD	37,780000	208.018,17	3,17
Verzinsliche Wertpapiere										
4,250000000% Commerzbank AG EO-FLR-Nachr. Anl.v.21(27/unb.)	DE000CZ45WA7		EUR	200	200	0	%	99,462000	198.924,00	3,03
2,900000000% Landesbank Baden-Württemberg Aktien-Anl 20(22) GXI	DE000LB2Q2L2		EUR	100	0	0	%	100,240000	100.240,00	1,53
1,600000000% Deutsche Bahn Finance GmbH Sub.-FLR-Nts.v.19(29/unb.)	XS2010039548		EUR	200	0	0	%	100,218500	200.437,00	3,05
4,000000000% Otto (GmbH & Co KG) Sub.-FLR- Nts.v.18(25/unb.)	XS1853998182		EUR	291	0	0	%	108,330000	315.240,30	4,80
Zertifikate										
Xetra-Gold	DE000A0S9GB0		STK	2.000	0	0	EUR	51,105000	102.210,00	1,56
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere							EUR	1.125.069,47	17,14	

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 31. DEZEMBER 2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.12.2021	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
Nicht notierte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
6,500000000% Nordex SE Senior Notes v.18(18/23) Reg.S	XS1713474168		EUR	300	0	0 %	101,193500	303.580,50	4,62
3,000000000% ZF Europe Finance B.V. EO-Notes 2019(19/29)	XS2010039894		EUR	300	0	0 %	103,582500	310.747,50	4,73
Summe der nicht notierten Wertpapiere							EUR	614.328,00	9,35
Investmentanteile									
KVG-eigene Investmentanteile									
Sustainable Small.Comp.ESG Fd. Inhaber-Anteile I	DE000A2QDRX0		ANT	4.000	0	0	EUR 130,250000	521.000,00	7,93
Summe der Investmentanteile							EUR	521.000,00	7,93
Summe Wertpapiervermögen							EUR	6.484.200,57	98,71
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
DAX Future 18.03.2022		XEUR	EUR	Anzahl -12				-117.175,00	-1,78
Summe der Aktienindex-Derivate							EUR	-117.175,00	-1,78
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	156.038,68				156.038,68	2,37
Bank: Norddeutsche Landesbank -GZ-			EUR	574,90				574,90	0,01
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	536,89				536,89	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			CHF	18.966,96				18.294,63	0,28
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			HKD	133.538,63				15.091,16	0,23
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			USD	1.679,66				1.480,01	0,02
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			JPY	1.214.383,00				9.306,69	0,14
Summe der Bankguthaben							EUR	201.322,96	3,06
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	25.247,14				25.247,14	0,38
Dividendenansprüche			EUR	3.773,58				3.773,58	0,06
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	29.020,72	0,44
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-28.500,46			EUR	-28.500,46	-0,43
Fondsvermögen							EUR	6.568.868,79	100,2)
Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P)									
Anteilwert							EUR	93,00	
Umlaufende Anteile							STK	21.231	
Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(SBA)									
Anteilwert							EUR	94,24	
Umlaufende Anteile							STK	48.749	

Fußnoten:

1) noch nicht abgeführte Zinsen laufendes Konto, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, 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 76,72 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 41.269.528,36 EUR.

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)		per 30.12.2021	
Kanadischer Dollar	CAD	1,452950	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	1,036750	= 1 Euro (EUR)
Hongkong-Dollar	HKD	8,848800	= 1 Euro (EUR)
Japanischer Yen	JPY	130,485000	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	NOK	9,964050	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,134900	= 1 Euro (EUR)
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					
Agile Property Holdings	KYG011981035	STK	-	160.000	
Verzinsliche Wertpapiere					
2,625000000% K+S Aktiengesellschaft Anleihe v.17/23	XS1591416679	EUR	-	300	
1,125000000% Schaeffler AG MTN v. 19/22	DE000A2YB699	EUR	-	100	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
MUL-LYX.DAILY LevDAX UCITS ETF	LU0252634307	ANT	1.100	1.100	
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: DAX Index		EUR			15.950,32
Zinsterminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: Bundesrep.Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe		EUR			9.431,51

ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure

EUR 4.749.900,00

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 %) 98,71
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) -1,78

Sonstige Angaben

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P)

Anteilwert EUR 93,00
Umlaufende Anteile STK 21.231

Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(SBA)

Anteilwert EUR 94,24
Umlaufende Anteile STK 48.749

	Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P)	Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(SBA)
Währung	EUR	EUR
Verwaltungsvergütung	1,82% p.a.	1,22% p.a.
Ausgabeaufschlag	5,00%	0,00%
Ertragsverwendung	ausschüttend	ausschüttend
Mindestanlagevolumen	-	EUR 100.000

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 für die Anteilklasse Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(P) sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesent-

entlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsf.(SBA) keine 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:

Sustainable Small.Comp.ESG Fd. Inhaber-Anteile I 1,6400 %
Die Verwaltungsvergütung für Gruppenfremde Investmentanteile beträgt:
MUL-LYX.DAILY LevDAX UCITS ETF 0,4000 %
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 Aufsichtsrates der SIGNAL IDU-
NA 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 Aufsichtsratsvorsit-
zender der HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied der Ge-
schäftsführung der SIGNAL IDUNA Asset Management
GmbH und der HANSAINVEST Real Assets GmbH sowie
Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Manage-
ment AG)

Nicholas Brinckmann (zugleich Sprecher der Geschäfts-
führung HANSAINVEST Real Assets GmbH)

Ludger Wibbeke (zugleich stellvertretender Aufsichtsrats-
vorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. sowie Vorsitzen-
der 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.com

HANSAINVEST