

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

HALBJAHRESBERICHT

D&R Zins Strategie

30. Juni 2023



DONNER & REUSCHEL
PRIVATBANK SEIT 1798

HANSAINVEST

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

D&R Zins Strategie

in der Zeit vom 01.01.2023 bis 30.06.2023.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von +2,36%.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Sondervermögens im Detail per Ende Juni 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

Vermögensübersicht per 30.06.2023

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	62.205.036,75	100,12
1. Anleihen	59.827.792,38	96,29
2. Derivate	41.394,52	0,07
3. Bankguthaben	1.441.423,57	2,32
4. Sonstige Vermögensgegenstände	894.426,28	1,44
II. Verbindlichkeiten	-73.841,67	-0,12
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-73.841,67	-0,12
III. Fondsvermögen	EUR 62.131.195,08	100,00

¹⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Vermögensaufstellung per 30.06.2023

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
						im Berichtszeitraum			
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	43.155.429,52	69,46
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	43.155.429,52	69,46
DE0001102515	0.0000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2020 (2035)	EUR		2.800	2.800	0 %	75,0525	2.101.470,00	3,38
DE0001102572	0.0000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2021 (2052)	EUR		2.500	2.500	2.400 %	50,8055	1.270.137,50	2,04
CH0006125253	0.0000% Scandinavian Airlines System SF-Anl. 1986(91/Und.)	CHF		8.920	0	0 %	11,5750	1.057.066,80	1,70
DE0001102465	0.2500% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2019 (2029)	EUR		300	300	0 %	88,4567	265.370,00	0,43
XS1720933297	0.3750% Aegon Bank N.V. EO-Med.-Term Cov. Bds 2017(24)	EUR		1.000	1.000	0 %	95,1567	951.567,41	1,53
NL0000120889	0.4960% AEGON N.V. FL-Anleihe 1996(11/Und.)	NLG		985	0	0 %	62,9200	281.235,73	0,45
NL0012650477	0.5000% Nationale-Nederlanden Bank NV EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 17(24)	EUR		300	300	0 %	95,7401	287.220,16	0,46
XS2078696866	0.6250% Grenke Finance PLC EO-MTN 19/25	EUR		200	0	0 %	90,7360	181.472,00	0,29
CH0005362055	0.7500% Kon. Luchtvaart Mij. N.V. SF-FLR Anl. 1985(95/ Undated)	CHF		420	0	0 %	24,0250	103.306,89	0,17
FR0013536976	0.7680% Société Générale S.A. YN-FLR Non-Pref. MTN 20(23/24)	JPY		200.000	200.000	0 %	99,8240	1.267.847,84	2,04
FR0013313582	1.2500% Frankreich EO-OAT 18/ 34	EUR		1.000	1.000	0 %	83,9200	839.199,94	1,35
NL0000121416	1.4250% AEGON FLR 96/08/ und.	NLG		480	0	0 %	71,5300	155.802,71	0,25
NL0000120004	1.5060% AEGON N.V. FL-Anleihe 1995(05/Und.)	NLG		20	0	0 %	79,9200	7.253,22	0,01
DE0001102614	1.8000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2022 (2053)	EUR		1.500	1.500	0 %	86,7175	1.300.762,50	2,09
XS1998902479	1.9500% AT & T Inc. EO-Notes 2019(19/23)	EUR		1.500	0	0 %	99,5875	1.493.812,50	2,40
XS2363244513	2.0000% Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2021/2024)	EUR		200	0	0 %	97,5520	195.104,00	0,31
DE000BU25000	2.2000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.187 v.2023(28)	EUR		200	200	0 %	98,2810	196.561,97	0,32
XS2330501995	2.2500% Athora Netherlands NV 21/31	EUR		300	0	0 %	84,0240	252.072,00	0,41
DE000BU2Z007	2.3000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2023 (2033)	EUR		1.500	2.400	900 %	99,0790	1.486.185,00	2,39
FR0014000N24	2.3750% Renault S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/26)	EUR		400	0	0 %	92,5880	370.352,00	0,60
XS2293060658	2.3760% Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2021(29/Und.)	EUR		600	0	0 %	78,8260	472.956,00	0,76
DE000A289FK7	2.6250% ALLIANZ SUB 20(31)/ und	EUR		1.000	0	0 %	70,1820	701.820,00	1,13
FR0014004AE8	3.0000% Air France-KLM S.A. EO-Obl. 2021(21/24)	EUR		200	0	0 %	98,2210	196.442,00	0,32
XS0210434782	3.0000% AXA EO-FLR-MTN 05/ 10/Und.	EUR		700	0	0 %	91,1045	637.731,50	1,03
FR0014005O90	3.0000% La Banque Postale EO-FLR Notes 2021(28/Und.)	EUR		1.800	0	0 %	66,2300	1.192.140,00	1,92

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum		
XS0202197694	3.0390% Banco Santander S.A. EO-FLR Notes 2004(09/Und.)		EUR	500	0	0 %	76,7500	383.750,00	0,62
XS0203470157	3.1390% AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 04(09/Und.)		EUR	1.400	0	0 %	80,8885	1.132.439,00	1,82
XS0197703118	3.1700% Rothschild&Co Cont.Finance PLC EO-FLR Notes 2004(14/Und.)		EUR	720	0	0 %	69,3600	499.392,00	0,80
XS2199567970	3.2500% UNIQA Insurance Group AG EO-FLR Bonds 2020(35)		EUR	200	0	0 %	92,8080	185.616,00	0,30
XS1713463559	3.3750% ENEL S.p.A. EO-FLR Cap. Secs 2018(26/UN)		EUR	600	0	0 %	91,9897	551.938,00	0,89
NL0000116168	3.5150% AEGON N.V. DL-FLR Nts 2004(14/Und.)		USD	600	0	0 %	76,0720	419.129,48	0,67
XS2056730679	3.6250% Infineon Technologies AG Sub.-FLR-Nts.v.19(28/unb.)		EUR	1.000	0	0 %	91,4590	914.590,00	1,47
XS2387925501	3.6250% Julius Baer Gruppe AG DL-FLR Bonds 2021(28/Und.)		USD	200	0	0 %	65,9975	121.207,53	0,20
XS1061711575	4.0000% AEGON N.V. EO-FLR MTN 2014(24/44)		EUR	200	0	0 %	98,3355	196.671,00	0,32
DE000WBP0A20	4.1250% Wüstenrot Bausparkasse AG Nachrang IHS v.17(27)		EUR	300	0	0 %	98,1940	294.582,00	0,47
AT0000A04967	4.1500% Österreich EO-MTN 144A 07/37		EUR	500	500	0 %	111,5745	557.872,59	0,90
XS1271836600	4.3820% Deutsche Lufthansa AG FLR-Sub.Anl.v.2015(2021/2075)		EUR	2.800	0	0 %	93,9705	2.631.174,00	4,23
XS1140860534	4.5960% Assicurazioni Generali S.p.A. EO-FLR MTN 14(25/Und.)		EUR	100	0	900 %	97,3745	97.374,50	0,16
BE0933899800	4.6081% BNP Paribas Fortis S.A. EO-FLR CV.Nts 07(Und.)		EUR	1.750	0	0 %	85,2460	1.491.805,00	2,40
DE000HCB0BS6	4.8750% Hamburg Commercial Bank AG IHS v. 2023(2025) S. 2755		EUR	2.000	2.000	0 %	99,6206	1.992.412,56	3,21
XS2238020445	4.8750% Julius Baer Gruppe AG DL-FLR Bonds 2020(26/Und.)		USD	600	0	0 %	86,9850	479.256,20	0,77
XS2432941693	5.0000% AT&S Austria Techn.&Systemt.AG EO-FLR Notes 2022(27/Und.)		EUR	800	0	0 %	88,3110	706.488,00	1,14
FR0008131403	5.2846% BNP Paribas S.A. DL-FLR-Notes 1986(91/Und.)		USD	500	0	0 %	92,3970	424.228,65	0,68
FR0011401751	5.3750% Electricité de France EO-FLR MTN 13/25		EUR	1.000	0	0 %	97,9125	979.125,00	1,58
GB0008424284	5.4375% Commonwealth Bank of Australia DL-FLR-Notes 1986(92/Und.)		USD	400	0	0 %	99,6385	365.981,63	0,59
GB0005902332	5.4375% HSBC Bank PLC DL-FLR-Notes 1985(90/Und.)		USD	800	0	0 %	99,9785	734.460,97	1,18
DK0030507694	5.5000% Nykredit Realkredit A/S EO-FLR Med.-T. Nts 2022(27/32)		EUR	2.000	0	0 %	98,1116	1.962.231,02	3,16
US381427AA15	5.7299% Goldman Sachs Capital II DL-FLR Pref.Secs 2007(12/Und.)		USD	500	0	0 %	76,5210	351.336,09	0,57
XS1261170515	5.7500% Argentum Netherlands B.V. DL-FLMTN LPN 15(25/50)Swiss Re		USD	600	0	0 %	96,5565	531.991,74	0,86
XS1055787680	6.2500% Norddeutsche Landesbank -GZ- Nachr.DL-IHS.S.1748 v.14/24		USD	3.600	0	0 %	97,1460	3.211.438,02	5,17
XS1002121454	6.5000% Stichting AK Rabobank Cert. EO-FLR-Certs 14/Und.		EUR	1.450	0	0 %	92,8965	1.347.440,51	2,17

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum		
XS0971213201	6.6250% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2013(23)		EUR	1.923	0	0 %	100,3885	1.930.470,86	3,11
SE0016278352	6.7500% Heimstaden AB EO-FLR Notes 21(21/Und.)		EUR	500	0	0 %	43,4610	217.305,00	0,35
XS2577033553	7.1250% Raiffeisenbank a.s. EO-FLR Non-Pref. MTN 23(25/26)		EUR	1.000	1.000	0 %	99,3598	993.597,50	1,60
XS1689189501	9.7230% GRENKE AG FLR-Subord. Bond v.17(23/unb.)		EUR	200	0	0 %	92,6175	185.235,00	0,30

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	16.106.544,63	25,92
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	16.106.544,63	25,92

DE000A2TSD55	0.0100% DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1220 20(24)		EUR	1.318	1.318	0 %	97,9355	1.290.789,89	2,08
FR0013201597	0.5000% RCI Banque S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/23)		EUR	123	0	0 %	99,3180	122.161,14	0,20
DE000A3E5TR0	2.6000% Allianz 21(32)/und		EUR	1.000	0	0 %	66,7025	667.025,00	1,07
XS2010032618	2.6240% Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB EO-FLR Cap. 2020(25/Und.)		EUR	700	0	0 %	20,1910	141.337,00	0,23
XS2272358024	2.6250% Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB Namn-Aktier Serie D o.N. 2020(26)/und		EUR	500	0	0 %	20,1470	100.735,00	0,16
USX10001AB51	3.2000% Allianz 21(28)/und		USD	1.400	0	0 %	74,0965	952.572,08	1,53
BE0002644251	3.2500% AGEAS SA/NV EO-FLR Notes 2019(29/49)		EUR	800	0	0 %	85,4855	683.884,19	1,10
US91282CGM73	3.5000% United States of America DL-Notes 2023(33) S.B-2033		USD	5.100	5.100	0 %	97,2500	4.554.407,71	7,33
US912810TN81	3.6250% United States of America DL-Bonds 2023(53)		USD	3.400	4.400	1.000 %	95,2422	2.973.585,30	4,79
DE000A2E4Q88	4.0000% IKB Deutsche Industriebank AG Nachr.-MTN-IHSv.17(27)		EUR	927	0	0 %	100,7795	934.225,97	1,50
XS2056490423	4.6250% Achmea B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 19(19/Und.)		EUR	1.600	0	0 %	77,8395	1.245.432,00	2,00
XS2468390930	5.3750% Athora Netherlands N.V. EO-FLR Notes 2022(22/32)		EUR	1.000	1.000	0 %	92,6170	926.170,00	1,49
XS2610457967	5.5000% AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 2023(33/43)		EUR	200	200	0 %	100,0665	200.133,04	0,32
USQ78063AJ59	5.8750% QBE Insurance Group Ltd. DL-FLR MTN 2020(25/Und.) Reg.S		USD	800	0	0 %	95,7550	703.434,34	1,13
US48123UAB08	6.3207% JPMorgan Chase & Co. DL-FLR Cap.E.Nts 17(18/47.77)W		USD	800	0	0 %	83,1250	610.651,97	0,98

Nicht notierte Wertpapiere							EUR	565.818,23	0,91
-----------------------------------	--	--	--	--	--	--	------------	-------------------	-------------

Verzinsliche Wertpapiere							EUR	565.818,23	0,91
DE000A3MP5T8	5.0000% Domicil Real Estate AG Pflichtwandelschuld.v. 21(24)		EUR	600	0	0 %	94,3030	565.818,23	0,91

Summe Wertpapiervermögen							EUR	59.827.792,38	96,29
---------------------------------	--	--	--	--	--	--	------------	----------------------	--------------

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.06.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
						im Berichtszeitraum			
Derivate							EUR	41.394,52	0,07
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Devisen-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)							EUR	41.394,52	0,07
Devisenterminkontrakte (Verkauf)							EUR	41.394,52	0,07
Offene Positionen							EUR	41.394,52	0,07
USD/EUR 1.00 Mio.		OTC		1.000.000				-4.259,01	-0,01
USD/EUR 1.32 Mio.		OTC		1.320.000				339,68	0,00
USD/EUR 15.75 Mio.		OTC		15.750.000				45.313,85	0,07
Bankguthaben							EUR	1.441.423,57	2,32
EUR - Guthaben bei:							EUR	426.099,40	0,69
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	426.099,40				426.099,40	0,69
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	1.015.324,17	1,63
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			CHF	3.490,56				3.573,65	0,01
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			JPY	154.426.875,00				980.674,89	1,58
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			USD	33.841,36				31.075,63	0,05
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	894.426,28	1,44
Zinsansprüche			EUR	894.426,28				894.426,28	1,44
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-73.841,67	-0,12
Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾			EUR	-73.841,67				-73.841,67	-0,12
Fondsvermögen							EUR	62.131.195,08	100,00
Anteilwert D&R Zins Strategie I							EUR	93,56	
Umlaufende Anteile D&R Zins Strategie I							STK	664.101,386	

¹⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

²⁾ noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

		per 30.06.2023			
Japanischer Yen	(JPY)	157,470000	=	1 Euro (EUR)	
Niederländischer Gulden	(NLG)	2,203710	=	1 Euro (EUR)	
Schweizer Franken	(CHF)	0,976750	=	1 Euro (EUR)	
US-Dollar	(USD)	1,089000	=	1 Euro (EUR)	

MARKTSCHLÜSSEL

OTC Over-the-Counter

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG ERSCHEINEN:

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
DE0001141778	0.0000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.177 v.2018(23)	EUR	0	1.200
FR00140057U9	0.8750% BNP Paribas S.A. 21(28)/33	EUR	0	500
XS2356569736	1.0000% Bayerische Landesbank FLR-Inh.Schv. v.21/31	EUR	0	1.000
XS2381272207	1.3750% EnBW Energie Baden-Württemberg AG 21(28)/81	EUR	0	200
DE000A3E5WW4	1.3750% Evonik Industries AG 21(26)/81	EUR	0	300
XS2290960520	1.6250% TotalEnergies S.E. EO-FLR MTN 21(21/Und.)	EUR	0	200
PTEDPROM0029	1.8750% EDP - Energias de Portugal SA EO-FLR Securities 2021(26)/81	EUR	0	200
DE0001102325	2.0000% Bundesrep.Deutschland Anl.v.13/23	EUR	3.600	5.100
XS2334852253	2.0000% ENI S.p.A. EO-FLR Nts 2021(27/Und.)	EUR	0	400
XS2381277008	2.1250% EnBW Energie Baden-Württemberg AG 21(32)/81	EUR	0	200
XS2320533131	2.5000% Repsol Intl Finance B.V. EO-FLR Notes 2021(21/Und.)	EUR	0	600
BE0000332412	2.6000% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 14/24 Ser. 72	EUR	2.700	2.700
FR0013459765	2.6250% RCI Banque S.A. EO-FLR MTN 2019(25/30)	EUR	0	500
XS2358835036	2.8750% Banco BPM S.p.A. EO-FLR MTN 2021(26/31)	EUR	0	800
XS2056371334	2.8750% Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2019(27/Und.)	EUR	0	600
XS2265369657	3.0000% LUFTHANSA AG 20/26	EUR	0	800
XS1205618470	3.0000% Vattenfall AB EO-FLR Cap. Secs 2015(27/77)	EUR	0	200
XS2363235107	3.5000% Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2021/2028)	EUR	0	300
XS1219499032	3.5000% RWE AG FLR-Sub.Anl. v.2015(2025/2075)	EUR	0	600
XS1206541366	3.5000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2015(30/Und.)	EUR	0	200
XS2187689034	3.5000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(25/Und.)	EUR	0	500
XS1795406658	3.8750% Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2018(26/Und.)	EUR	0	400
XS2187689380	3.8750% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	EUR	0	1.100
DE000CZ45WA7	4.2500% Commerzbank AG EO-FLR-Nachr.Anl.v.21(27/unb.)	EUR	0	1.400
FR0010466938	4.2500% Frankreich 07/23	EUR	1.000	1.000
DE000DL19VZ9	4.6250% Deutsche Bank AG Med.Term Nts.v.2021(2028)	EUR	0	400
XS1693822634	4.7500% ABN AMRO Bank N.V. EO-FLR Cap. Secs 2017(27/Und.)	EUR	0	200
XS1577953331	4.7500% Jyske Bank A/S EO-FLR MTN 17(27/Und.)	EUR	0	400
FR001400FB22	5.1250% BPCE S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2023(30/35)	EUR	1.000	1.000
ES0840609012	5.2500% Caixabank S.A. EO-FLR Notes 2018(26/Und.)	EUR	0	800
XS0179407910	5.8440% HSBC Bank Cap.Fdg (Sterl.1) LP LS-FLR Tr.Pref.Secs03(31/Und.)	GBP	0	400
USJ6S87BAX69	6.2500% Rakuten Inc. DL-FLR Nts 2021(21/UND.) Reg.S	USD	0	200
CH0286864027	6.8750% UBS Group AG DL-FLR Bonds 2015(25/Und.)	USD	0	600
USH3698DBZ62	7.2500% Credit Suisse Group AG DL-FLR Bds 2018(25/Und.) Reg.S	USD	0	800

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG ERSCHEINEN:

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):				
ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
DE0001141802	0.0000% Bundesrep.Deutschland Bundesobl.Ser.180 v.2019(24)	EUR	0	2.000
DE0001102309	1.5000% Bundesrep.Deutschland 13/23	EUR	0	1.000
XS2050933972	3.2500% Coöperative Rabobank U.A. EO-FLR Cap.Sec.2019(26/Und.)	EUR	0	1.000
XS2342620924	4.1250% Banco Santander S.A. EO-FLR Nts 2021(27/Und.)	EUR	0	400
FR001400CKA4	5.2500% Société Générale S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(27/32)	EUR	0	200
XS0413650218	7.9220% Mitsub. UFJ Invest.Ser.Bk.Dep. EO-FLR Exch. Notes 2009(50)	EUR	0	2.800
US912796T338	0.0000% United States of America DL-Treasury Bills 2022(23)	USD	0	4.000
US912796X538	0.0000% United States of America DL-Treasury Bills 2022(23)	USD	0	1.700
US912828YY08	1.7500% United States of America DL-Notes 2019(24)	USD	0	1.000
US912810RY64	2.7500% United States of America DL-Notes 2017(47)	USD	0	1.000
US251526BN89	4.8750% Deutsche Bank AG FLR-Sub.Anl. v.2017(2027/2032)	USD	0	200
US404280AS86	6.3750% HSBC Holdings PLC DL-FLR Cap.Notes 2014(24/Und.)	USD	0	800

DERIVATE

(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
Terminkontrakte				
Devisenterminkontrakte (Verkauf)				
Verkauf von Devisen auf Termin:				
USD/EUR	EUR			1.408

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

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 113.325.157,24 EUR.

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 96,29

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 0,07

ZUSÄTZLICHE ANHANGANGABEN GEMÄSS DER VERORDNUNG (EU) 2015/2365 BETREFFEND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Während des Berichtszeitraums wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

SONSTIGE ANGABEN

Anteilwert D&R Zins Strategie I	EUR	93,56
Umlaufende Anteile D&R Zins Strategie I	STK	664.101,386

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 für die Anteilklasse D&R Zins Strategie I keine sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

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

Allgemeine Angaben

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT

HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft
mit beschränkter Haftung

Postfach 60 09 45

22209 Hamburg

Hausanschrift:

Kapstadtring 8

22297 Hamburg

Sitz: Hamburg

Telefon: (0 40) 3 00 57 - 62 96

Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70

E-Mail: service@hansainvest.de

Web: www.hansainvest.de

Haftendes Eigenkapital: 28,189 Mio. EUR

Eingezahltes Eigenkapital: 10,500 Mio. EUR

Stand: 31.12.2022

GESELLSCHAFTER

SIGNAL IDUNA Allgemeine Versicherung AG,

Dortmund

SIGNAL IDUNA Lebensversicherung a.G., Hamburg

AUFSICHTSRAT

- Martin Berger
 - Vorsitzender
 - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg (zugleich Vorsitzender des Aufsichtsrates 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

GESCHÄFTSFÜHRUNG

- Dr. Jörg W. Stotz

- (Sprecher, zugleich Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied der Geschäftsführung der HANSAINVEST Real Assets GmbH, Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Management AG sowie Mitglied des Aufsichtsrates der Greiff capital management AG (seit 01.03.2023))

- Nicholas Brinckmann

- (zugleich Sprecher der Geschäftsführung HANSAINVEST Real Assets GmbH)

- Ludger Wibbeke

- (zugleich stellvertretender Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. sowie Vorsitzender des Aufsichtsrates der WohnSelect Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

VERWAHRSTELLE

Donner & Reuschel AG
Ballindamm 27
20095 Hamburg

Haftendes Eigenkapital: 380,667 Mio. EUR
Eingezahltes Eigenkapital: 20,500 Mio. EUR
Stand: 31.12.2021

WIRTSCHAFTSPRÜFER

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Fuhlentwiete 5
20355 Hamburg
Deutschland

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Telefon 040 30057-6296

service@hansainvest.de
www.hansainvest.de

HANSAINVEST