

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

HALBJAHRESBERICHT

Rücklagenfonds

31. Mai 2023

HANSAINVEST

Inhaltsverzeichnis

Vermögensübersicht per 31.05.2023	4
Vermögensaufstellung per 31.05.2023	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	12
Allgemeine Angaben	15

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

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

Rücklagenfonds

in der Zeit vom 01.12.2022 bis 31.05.2023.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von +2,13 % in der Klasse A, eine Wertentwicklung von +2,56 % in der Klasse I, eine Wertentwicklung von +3,48 % in der Klasse I USD sowie von +2,36 % in der Klasse R.

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

Vermögensübersicht per 31.05.2023

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	144.192.114,53	100,10
1. Anleihen	128.934.996,55	89,50
2. Investmentanteile	8.125.084,54	5,64
3. Derivate	2.364.798,54	1,64
4. Bankguthaben	3.673.962,36	2,55
5. Sonstige Vermögensgegenstände	1.093.272,54	0,76
II. Verbindlichkeiten	-137.112,42	-0,10
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-137.112,42	-0,10
III. Fondsvermögen	EUR 144.055.002,11	100,00

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

Vermögensaufstellung per 31.05.2023

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.05.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.05.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
						im Berichtszeitraum			
Börsengehandelte Wertpapiere							EUR	50.189.545,57	34,84
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	50.189.545,57	34,84
XS1843441731	0,000000000% ALROSA Finance S.A. DL-Notes 2019(19/24) Reg.S	USD		2.100	0	0 %	12,3431	241.614,81	0,17
CH0419041618	0,000000000% RZD Capital PLC SF-LPN 2019(25) Russ.Railways	CHF		2.100	0	0 %	59,2500	1.283.062,65	0,89
XS2297244878	0,625000000% Inter-Amer. Invest. Corp.-IIC- DL-MTN 21/26	USD		2.000	0	2.000 %	90,1160	1.680.014,91	1,17
CH1104885954	0,935000000% Cellnex Telecom S.A. SF-Medium-Term Notes 2021(26)	CHF		2.000	0	0 %	95,3665	1.966.826,50	1,37
XS2331739750	1,500000000% Banco Santander S.A. EO-Med.-Term Notes 2021(26)	GBP		1.800	0	0 %	87,1600	1.814.783,11	1,26
XS2315967989	1,500000000% Naver Corp. DL-Notes 21/26	USD		2.500	0	0 %	89,5975	2.087.935,78	1,45
XS2362559481	1,625000000% Hyundai Assan Otom. S.V.T.A.S. DL-Notes 2021(26) Reg.S	USD		2.300	0	0 %	87,4880	1.875.674,87	1,30
XS1622421722	1,750000000% Akelius Residential Property EO-Med.-Term Notes 2017(17/25)	EUR		1.400	0	0 %	93,7784	1.312.897,96	0,91
XS2197770279	1,750000000% Bright Food SG Hldgs Pte. Ltd. EO-Notes 2020(20/25)	EUR		2.000	0	0 %	91,6030	1.832.060,00	1,27
XS2325566847	1,750000000% Korea Resources Corp. DL-Med.-Term Notes 2021(25/26)	USD		2.400	0	0 %	89,6115	2.004.731,54	1,39
XS2235988206	1,810000000% ICDPS Sukuk Ltd. DL-Med.-Term Notes 2020(25)	USD		1.400	0	0 %	92,3500	1.205.164,06	0,84
XS2281816095	1,850000000% BNP Paribas Issuance B.V. DL-Cred.Lkd M.-T. Cts 21/26	USD		2.000	0	0 %	87,2596	1.626.763,70	1,13
XS2229418145	1,875000000% Contemporary Ruiding Dev. Ltd. DL-Notes 2020(25)	USD		2.400	0	0 %	92,2820	2.064.474,27	1,43
XS2226808082	2,000000000% CNAC (HK) Finbridge Co. Ltd. DL-Notes 2020(20/25)	USD		2.400	0	0 %	91,8640	2.055.123,04	1,43
AU3CB0268142	2,100000000% Verizon Communications Inc. AD-Med.-Term Nts 2019(26)	AUD		3.000	0	0 %	92,9525	1.693.895,22	1,18
XS2306847232	2,250000000% REC Ltd. DL-Med.-Term Notes 2021(26)	USD		2.400	0	0 %	89,6845	2.006.364,65	1,39
XS2461786829	2,375000000% CEZ AS EO-Medium-Term Nts 2022(22/27)	EUR		1.500	1.500	0 %	93,0907	1.396.361,18	0,97
XS2125306113	2,650000000% Nomura 20/25 CLN Israel	USD		1.800	0	0 %	94,4237	1.584.290,79	1,10
XS1891336932	2,875000000% PT Perusahaan Listrik Negara EO-Med.-Term Nts 2018(25)Reg.S	EUR		2.000	0	0 %	96,4340	1.928.680,00	1,34
XS2125309307	3,060000000% Nomura Bank International PLC DL-Cred.Lkd MTN 2020(25)	USD		1.300	0	0 %	94,6817	1.147.335,59	0,80
XS2189425122	3,125000000% Africa Finance Corp. DL-Med.-Term Nts 2020(25)Reg.S	USD		2.200	0	0 %	92,4190	1.895.244,22	1,32
XS2018639539	3,500000000% Black Sea Trade & Developmt Bk DL-Med.-Term Nts 19(24)	USD		2.000	0	0 %	93,5750	1.744.500,37	1,21
US456837BA00	3,869000000% ING Groep N.V. DL-FLR Notes 2022(25/26)	USD		3.500	0	0 %	96,2395	3.139.804,72	2,18

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.05.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.05.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum		
USY72596BU56	4,125000000% Reliance Industries Ltd. DL-Notes 2015(15/25) Reg.S		USD	1.700	0	0 %	97,9510	1.552.169,09	1,08
US670346AY11	4,300000000% Nucor Corp. DL-Notes 2022(22/27)		USD	2.200	0	0 %	97,9150	2.007.951,16	1,39
RU000A0JWHA4	4,750000000% Russische Föderation DL-Bonds 2016(26) Reg.S		USD	2.200	0	0 %	44,5970	914.553,89	0,63
XS1291333760	4,750000000% Santander UK Group Hldgs PLC DL-Medium-T.Nts 2015(25) Reg.S		USD	1.100	0	0 %	96,0225	984.570,75	0,68
AU3FN0041042	5,032400000% Lloyds Banking Group PLC AD-FLR Med.-Term Nts 2018(25)		AUD	4.800	0	0 %	99,2845	2.894.855,58	2,01
USH42097DA27	5,726640000% UBS Group AG DL-FLR Notes 2022(25/26) Reg.S		USD	2.400	0	0 %	100,4785	2.247.841,16	1,56
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	76.918.707,88	53,40
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	76.918.707,88	53,40
USG91139AF57	1,250000000% TSMC Global Ltd. DL-Notes 2021(21/26) Reg.S		USD	2.400	0	0 %	89,7125	2.006.991,05	1,39
US09659X2N16	1,323000000% BNP Paribas S.A. DL-Non-Pref.FLM 21(26/27)Reg.S		USD	2.500	0	0 %	89,3265	2.081.620,53	1,45
XS2287744218	1,375000000% QNB Finance Ltd. DL-Medium-Term Notes 2021(26)		USD	2.400	0	0 %	91,0635	2.037.214,77	1,41
US69370RAK32	1,400000000% PT Pertamina (Persero) DL-Med.-T.Nts 21(26/26) Reg.S		USD	2.400	0	0 %	90,8925	2.033.389,26	1,41
USU2339CEA28	1,450000000% Daimler Finance North Amer.LLC DL-Notes 2021(21/26) Reg.S		USD	2.300	0	0 %	91,1585	1.954.367,54	1,36
US40434LAF22	1,450000000% HP Inc. DL-Notes 2022(22/26)		USD	2.400	0	0 %	89,7530	2.007.897,09	1,39
US86562MCA62	1,474000000% Sumitomo Mitsui Financ. Group DL-Notes 2020(25)		USD	2.200	0	0 %	91,9400	1.885.421,33	1,31
USY8085FBA76	1,500000000% SK Hynix Inc. DL-Notes 2021(26) Reg.S		USD	2.400	0	0 %	88,2935	1.975.246,09	1,37
USU9841MAA00	1,500000000% Wipro IT Services LLC DL-Notes 2021(21/26) Reg.S		USD	2.300	0	0 %	89,6055	1.921.072,43	1,33
XS2466186074	1,625000000% First Abu Dhabi Bank P.J.S.C EO-Medium-Term Notes 2022(27)		EUR	2.500	0	0 %	91,9683	2.299.208,65	1,60
XS2249462016	1,625000000% Sinochem Offshore Cap.Co.Ltd. DL-Medium-Term Nts 2020(25)		USD	1.600	0	0 %	90,9760	1.356.838,18	0,94
US04686E3K65	1,730000000% Athene Global Funding DL-Med.-Term Nts 2021(26)Reg.S		USD	2.400	0	0 %	86,0435	1.924.910,51	1,34
XS2377126250	1,810000% HSBC BANK 21/26 MTN		USD	2.000	0	0 %	89,1278	1.661.591,78	1,15
XS2080932077	1,810000000% Goldman Sachs CLN Chile 21/26		USD	2.000	0	0 %	92,0465	1.716.004,79	1,19
XS2285492588	1,880000000% Barclays Bank CLN Abu Dhabi National Energy 21/26		USD	2.000	0	0 %	90,4503	1.686.247,43	1,17
XS2373400865	1,960000000% HSBC CLN 21/26 Indonesian State		USD	2.000	0	0 %	90,6461	1.689.897,56	1,17
XS2377129197	1,960000000% Nomura CLN 21/26 Volkswagen AG		USD	2.000	0	0 %	86,8745	1.619.584,77	1,12

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.05.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.05.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum		
AU3CB0279305	2,000000000% VW Finan. Serv. Austr.Pty.Ltd. AD-Medium-Term Notes 2021(26)		AUD	1.500	0	0 %	92,3270	841.248,29	0,58
XS2269594599	2,050000000% BNP Paribas Issuance B.V. DL-Cred.Lkd M.-T. Cts 21/26		USD	2.000	0	0 %	92,2255	1.719.341,52	1,19
XS2347840998	2,080000000% Société Générale S.A. CLN 21/26 Vivendi SE		USD	2.400	0	0 %	88,8000	1.986.578,06	1,38
XS2253873975	2,120000000% BNP CLN Anglo 21/26		USD	1.800	0	0 %	89,3191	1.498.643,14	1,04
XS2152296021	2,120000000% Credit Suisse AG CLN on Baidu Inc. 2021(26)		USD	2.200	0	0 %	85,7900	1.759.302,76	1,22
XS2152296708	2,250000000% Credit Suisse AG (Ldn Br.) DL-Credit Linked MTN 2021(26)		USD	2.200	0	0 %	82,0844	1.683.311,09	1,17
XS1909057306	2,250000000% Logicor Financing S.à.r.l. EO-Medium-Term Nts 2018(18/25)		EUR	1.500	0	0 %	92,6326	1.389.488,46	0,96
XS2372746367	2,300000000% Nomura CLN 21/26 Mexican State		USD	2.000	0	0 %	88,4041	1.648.099,81	1,14
XS2305965571	2,440000000% Barclays CLN 21/26 Glencore Int. AG		USD	2.400	0	0 %	90,1996	2.017.887,54	1,40
XS2105904713	2,500000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl DL-Credit Linked MTN 2020(24)		USD	1.600	0	0 %	95,9701	1.431.321,05	0,99
XS1998943077	2,570000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl DL-Credit Linked MTN 2022(26)		USD	2.500	0	0 %	88,3823	2.059.617,10	1,43
US05968AAG13	2,704000000% Banco del Estado de Chile DL-MTN 20/25		USD	2.500	0	0 %	96,2315	2.242.531,23	1,56
XS2378924455	2,740000000% SG EFF. CLN 21/27 Alstom		USD	2.500	0	0 %	87,3400	2.035.328,11	1,41
USG2519YAA67	2,750000000% Credicorp Ltd. DL-Notes 2020(20/25) Reg.S		USD	2.200	0	0 %	94,4940	1.937.796,42	1,35
XS1505674918	3,244000000% TNB Global Ventures Cap. Bhd DL-Med.-T. Nts 2016(26)		USD	2.500	0	0 %	93,1545	2.170.826,34	1,51
XS1971448581	3,620000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl DL-Credit Linked MTN 2019(24)		USD	1.550	0	0 %	98,9537	1.429.699,71	0,99
XS1458462006	3,700000000% Wells Fargo & Co. AD-Medium-Term Notes 2016(26)		AUD	4.000	0	0 %	95,5090	2.320.643,89	1,61
USP8674JAE93	4,125000000% Sigma Alimentos S.A. DL-Notes 2016(16/26) Reg.S		USD	2.400	0	0 %	96,4120	2.156.868,01	1,50
XS1971449985	4,130000000% Goldman Sachs Fin. Corp. Intl DL-Credit Linked MTN 2019(24)		USD	1.550	0	0 %	97,1763	1.404.020,20	0,97
XS1842869718	4,300000000% Société Générale S.A. CLN 2018/2023		USD	1.400	0	0 %	103,5097	1.350.798,28	0,94
USP4948KAD74	4,875000000% Gruma S.A.B. de C.V. DL-Notes 2014(14/24) Reg.S		USD	1.700	0	0 %	99,6190	1.578.600,86	1,10
XS2150023906	5,000000000% MEGlobal Canada ULC DL-Med.-Term Nts 2020(25)Reg.S		USD	2.300	0	0 %	98,8290	2.118.817,11	1,47
USP9406GAC26	5,250000000% Trust F/1401 DL-Notes 2015(15/26) Reg.S		USD	2.000	0	0 %	94,6665	1.764.848,99	1,23
XS2555412001	6,693000000% Česká Sporitelna AS EO-FLR Non-Pref.MTN 22(24/25)		EUR	3.000	3.000	0 %	101,1161	3.033.483,24	2,11
US832724AB40	7,500000000% Smurfit Kappa Treasury Funding DL-Notes 1995(25)		USD	1.500	0	0 %	106,0000	1.482.102,91	1,03

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.05.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.05.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
Nicht notierte Wertpapiere							EUR	1.826.743,10	1,27
Verzinsliche Wertpapiere							EUR	1.826.743,10	1,27
USF0803NAD42	4,753000000% Bque Fédérative du Cr. Mutuel DL-Preferred Nts 2022(27)Reg.S	USD		2.000	0	0 %	97,9865	1.826.743,10	1,27
Investmentanteile							EUR	8.125.084,54	5,64
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	8.125.084,54	5,64
IE00B6TLWG59	GAM STAR Fd PLC-GAM St.Cat Bd. Regist.Shs Inst.Acc.EUR o.N.	ANT		123.000	0	0 EUR	14,4977	1.783.217,10	1,24
IE00BWZN1Z90	Legg M.Gl.Fds-LM WA Mac.Op.Bd Reg.Shs.X EUR Dis(A) (Hgd.)o.N.	ANT		26.900	0	0 EUR	74,0700	1.992.483,00	1,38
LU0951570927	Schroder GAIA-Schr.GAIA Cat Bd Regist.Acc.Shs IF EUR Hed.o.N.	ANT		1.300	0	0 EUR	1.363,1300	1.772.069,00	1,23
IE00BDCJYP85	BNY MGF-BNY M.U.S.Mun.Inf.Debt Reg. Shs C USD Acc. oN	ANT		2.520.000	0	0 USD	1,0972	2.577.315,44	1,79
Summe Wertpapiervermögen							EUR	137.060.081,09	95,14
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)							EUR	2.364.798,54	1,64
Zins-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)							EUR	-65.541,11	-0,05
Zinsterminkontrakte							EUR	-65.541,11	-0,05
	Five-Year U.S. Treasury Notes Futures 09/23 29.09.2023	XCBT	USD	-30.000.000				-65.541,11	-0,05
Devisen-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)							EUR	2.430.339,65	1,69
Devisenterminkontrakte (Verkauf)							EUR	2.392.210,28	1,66
Offene Positionen							EUR	1.980.101,25	1,37
	AUD/EUR 0.50 Mio.		OTC	500.000				21.861,32	0,02
	AUD/EUR 12.00 Mio.		OTC	12.000.000				360.175,97	0,25
	CHF/EUR 0.40 Mio.		OTC	400.000				-10.653,31	-0,01
	CHF/EUR 2.00 Mio.		OTC	2.000.000				-15.285,65	-0,01
	GBP/EUR 1.40 Mio.		OTC	1.400.000				-16.375,92	-0,01
	USD/EUR 0.20 Mio.		OTC	200.000				-3.342,04	0,00
	USD/EUR 0.50 Mio.		OTC	500.000				582,75	0,00
	USD/EUR 0.70 Mio.		OTC	700.000				-13.869,36	-0,01
	USD/EUR 0.70 Mio.		OTC	700.000				-3.776,20	0,00
	USD/EUR 1.00 Mio.		OTC	1.000.000				-4.066,72	0,00
	USD/EUR 1.00 Mio.		OTC	1.000.000				12.973,44	0,01
	USD/EUR 13.30 Mio.		OTC	13.300.000				-319.900,85	-0,22
	USD/EUR 13.30 Mio.		OTC	13.300.000				-360.579,36	-0,25
	USD/EUR 23.90 Mio.		OTC	23.900.000				319.512,27	0,22
	USD/EUR 24.00 Mio.		OTC	24.000.000				289.126,91	0,20
	USD/EUR 34.50 Mio.		OTC	34.500.000				1.723.718,00	1,20

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.05.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.05.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
Geschlossene Positionen							EUR	412.109,03	0,29
	USD/EUR 0.80 Mio.	OTC		800.000				59.269,70	0,04
	USD/EUR 1.50 Mio.	OTC		1.500.000				36.560,81	0,03
	USD/EUR 4.50 Mio.	OTC		4.500.000				316.278,52	0,22
Devisenterminkontrakte (Kauf)							EUR	38.129,37	0,03
Offene Positionen							EUR	24.371,95	0,02
	USD/EUR 0.05 Mio.	OTC		50.000				550,26	0,00
	USD/EUR 0.05 Mio.	OTC		50.000				891,79	0,00
	USD/EUR 0.06 Mio.	OTC		60.000				311,01	0,00
	USD/EUR 0.06 Mio.	OTC		60.000				1.871,75	0,00
	USD/EUR 0.08 Mio.	OTC		75.000				-4.675,60	0,00
	USD/EUR 0.08 Mio.	OTC		75.000				-4.045,59	0,00
	USD/EUR 0.08 Mio.	OTC		75.000				-835,13	0,00
	USD/EUR 0.14 Mio.	OTC		145.000				3.630,95	0,00
	USD/EUR 0.15 Mio.	OTC		150.000				-2.795,62	0,00
	USD/EUR 0.18 Mio.	OTC		175.000				2.650,86	0,00
	USD/EUR 0.27 Mio.	OTC		270.000				3.374,39	0,00
	USD/EUR 0.55 Mio.	OTC		550.000				12.749,34	0,01
	USD/EUR 1.56 Mio.	OTC		1.560.000				-20.975,84	-0,01
	USD/EUR 4.52 Mio.	OTC		4.525.000				31.669,38	0,02
Geschlossene Positionen							EUR	13.757,42	0,01
	USD/EUR 1.32 Mio.	OTC		1.315.000				13.757,42	0,01
Bankguthaben							EUR	3.673.962,36	2,55
EUR - Guthaben bei:							EUR	2.455.590,86	1,70
	Bank: Hamburger Volksbank		EUR	0,61				0,61	0,00
	Bank: ODDO BHF-Bank AG		EUR	22,88				22,88	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		EUR	2.455.567,37				2.455.567,37	1,70
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	1.218.371,50	0,85
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		AUD	319,47				194,06	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		CHF	25.958,21				26.767,94	0,02
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		CNY	202,57				26,67	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		GBP	634,14				733,53	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		HKD	60,56				7,21	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		NZD	2,77				1,56	0,00
	Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG		USD	1.277.319,16				1.190.640,53	0,83
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	1.093.272,54	0,76
	Zinsansprüche		EUR	1.093.272,54				1.093.272,54	0,76

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.05.2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.05.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
	Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-137.112,42	-0,10
	Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾		EUR	-137.112,42				-137.112,42	-0,10
	Fondsvermögen						EUR	144.055.002,11	100,00
	Anteilwert Rücklagenfonds I						EUR	923,55	
	Anteilwert Rücklagenfonds R						EUR	48,84	
	Anteilwert Rücklagenfonds A						EUR	45,09	
	Anteilwert Rücklagenfonds I USD						USD	1.068,41	
	Umlaufende Anteile Rücklagenfonds I						STK	68.774,000	
	Umlaufende Anteile Rücklagenfonds R						STK	1.401.343,000	
	Umlaufende Anteile Rücklagenfonds A						STK	106.417,000	
	Umlaufende Anteile Rücklagenfonds I USD						STK	7.324,000	

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 31.05.2023		
Australischer Dollar	(AUD)	1,646250	=	1 Euro (EUR)
Britisches Pfund	(GBP)	0,864500	=	1 Euro (EUR)
Hongkong-Dollar	(HKD)	8,403600	=	1 Euro (EUR)
Neuseeland-Dollar	(NZD)	1,774450	=	1 Euro (EUR)
Renminbi Yuan	(CNY)	7,595150	=	1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,969750	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,072800	=	1 Euro (EUR)

MARKTSCHLÜSSEL

Terminbörse

XCBT CHICAGO BOARD OF TRADE

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				
XS2265801238	0,7920000000% Luminor Bank AS EO-FLR Preferred MTN 20(23/24)	EUR	0	1.700
XS2034622048	1,6980000000% EP Infrastructure a.s. EO-Notes 19/26	EUR	0	2.000
XS2258986269	2,1250000000% Cromwell Ereit Lx.Fin. S.à.r.l EO-Medium-Term Nts 2020(20/25)	EUR	0	1.525
XS2203995670	1,7400000000% Saudi Electr. Glb. SUKUK Co.5 DL-Bonds 2020(25)	USD	0	2.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
XS2346922755	0,0000000000% Steel Funding DAC EO-LPN 21(21/26)Novolipe.Steel	EUR	0	2.000
XS2050933899	0,6000000000% Kasachstan, Republik EO-Med.-Term Nts 2019(26)Reg.S	EUR	0	2.200
XS1677912393	1,8750000000% Fastighets AB Balder EO-Notes 2017(17/26)	EUR	0	1.500
USU2479QAA59	1,3750000000% HCL America Inc. DL-Notes 2021(21/26) Reg.S	USD	0	2.400
US05530QAN07	1,6680000000% B.A.T. Intl Finance PLC DL-Notes 2020(20/26)	USD	0	2.400
US89114TZT23	2,8000000000% Toronto-Dominion Bank, The DL-Medium-Term Nts 2022(22/27)	USD	0	2.400
US13607HR618	3,4500000000% Can. Imp. Bk of Comm.(Tor.Br.) DL-Notes 2022(22/27)	USD	0	2.400
XS1372846003	4,2500000000% NTPC Ltd. DL-Med.-Term Notes 2016(26)	USD	0	2.400
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
DE000A2DKRH6	nordIX Treasury plus Inhaber-Anteile I	ANT	0	27.000

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				
Zinsterminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswerte:	EUR			82.743
5Yr. Australia Treasury Bonds (synth. Anleihe)				
5Yr. U.S.A. States Treasury Notes (synth. Anleihe))				

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 251.425.194,04 EUR.

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 93,99

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 1,64

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 Rücklagenfonds I	EUR	923,55
Anteilwert Rücklagenfonds R	EUR	48,84
Anteilwert Rücklagenfonds A	EUR	45,09
Anteilwert Rücklagenfonds I USD	USD	1.068,41
Umlaufende Anteile Rücklagenfonds I	STK	68.774,000
Umlaufende Anteile Rücklagenfonds R	STK	1.401.343,000
Umlaufende Anteile Rücklagenfonds A	STK	106.417,000
Umlaufende Anteile Rücklagenfonds I USD	STK	7.324,000

ANTEILKLASSEN AUF EINEN BLICK

	Rücklagenfonds I	Rücklagenfonds R
ISIN	DE000A1J67R2	DE000A1JRP89
Währung	Euro	Euro
Fondsaufgabe	08.01.2013	06.06.2012
Ertragsverwendung	Ausschüttend	Ausschüttend
Verwaltungsvergütung	0,45% p.a.	0,85% p.a.
Ausgabeaufschlag	0,00%	0,00%
Mindestanlagevolumen	100.000	0

	Rücklagenfonds A	Rücklagenfonds I USD
ISIN	DE000A1JRP97	DE000A2JF832
Währung	Euro	USD
Fondsaufgabe	06.06.2012	20.06.2018
Ertragsverwendung	Ausschüttend	Thesaurierend
Verwaltungsvergütung	1,33% p.a.	0,39% p.a.
Ausgabeaufschlag	0,00%	0,00%
Mindestanlagevolumen	0	0

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 PAUSCHAL-VERGÜTUNGEN

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 Rücklagenfonds I sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse Rücklagenfonds I USD keine sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse Rücklagenfonds R sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

Die KVG gewährt für die Anteilklasse Rücklagenfonds A sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

VERWALTUNGSVERGÜTUNGSSATZ FÜR IM SONDERVERMÖGEN GEHALTENE INVESTMENTANTEILE

ISIN	Fondsname	Nominale Verwaltungsvergütung der Zielfonds in %
IE00BDCJYP85	BNY MGF-BNY M.U.S.Mun.Inf.Debt Reg. Shs C USD Acc. o.N. ¹⁾	0,50
IE00B6TLWG59	GAM STAR Fd PLC-GAM St.Cat Bd. Regist.Shs Inst.Acc.EUR o.N. ¹⁾	0,95
IE00BWZN1Z90	Legg M.Gl.Fds-LM WA Mac.Op.Bd Reg.Shs.X EUR Dis(A)(Hgd.)o.N. ¹⁾	1,00
DE000A2DKRH6	nordIX Treasury plus Inhaber-Anteile I ¹⁾	0,65
LU0951570927	Schroder GAIA-Schr.GAIA Cat Bd Regist.Acc.Shs IF EUR Hed.o.N. ¹⁾	1,10

¹⁾ Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge 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

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