

Halbjahresbericht zum 30. Juni 2021

D&R Zins Strategie



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 1. Januar 2021 bis 30. Juni 2021.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von + 3,20 % in der Klasse I.

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

Hamburg, im August 2021

So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensübersicht per 30. Juni 2021	4
Vermögensaufstellung per 30. Juni 2021	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	9
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien	11

Vermögensübersicht per 30. Juni 2021

Fondsvermögen: EUR 62.919.897,81 (49.415.613,24)

Umlaufende Anteile: I-Klasse 546.911 (443.252)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens per 31.12.2020
I. Vermögensgegenstände			
1. Anleihen	60.820	96,66	(98,05)
2. Derivate	-37	-0,05	(0,01)
3. Bankguthaben	1.709	2,71	(1,75)
4. Sonstige Vermögensgegenstände	649	1,03	(1,43)
II. Verbindlichkeiten			
	-221	-0,35	(-1,24)
III. Fondsvermögen			
	62.920	100,00	

Vermögensaufstellung per 30. Juni 2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens	
					im Berichtszeitraum					
Börsengehandelte Wertpapiere										
Verzinsliche Wertpapiere										
4,750000000% ABN AMRO Bank N.V. EO-FLR Cap. Secs 2017(27/Und.)	XS1693822634		EUR	200	0	0	% 110,592000	221.184,00	0,35	
4,000000000% AEGON N.V. EO-FLR MTN 2014(24/44)	XS1061711575		EUR	200	0	0	% 110,185000	220.370,00	0,35	
3,875000000% Air France-KLM 21/26	FR0014004AF5		EUR	600	600	0	% 98,837500	593.025,00	0,94	
3,000000000% Air France-KLM S.A. EO-Obl. 2021(21/24)	FR0014004AE8		EUR	200	200	0	% 99,295000	198.590,00	0,32	
4,596000000% Assicurazioni Generali S.p.A. EO-FLR MTN 14(25/Und.)	XS1140860534		EUR	1.000	0	0	% 112,761000	1.127.610,00	1,79	
2,250000000% Athora Netherlands NV 21/31	XS2330501995		EUR	300	300	0	% 101,504500	304.513,50	0,48	
3,000000000% AXA EO-FLR-MTN 05/10/Und.	XS0210434782		EUR	700	0	0	% 102,441500	717.090,50	1,14	
0,146000000% AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 04(09/Und.)	XS0203470157		EUR	1.400	200	200	% 89,548000	1.253.672,00	1,99	
2,924000000% Banco BPM S.p.A. EO-FLR MTN 2021(26/31)	XS2358835036		EUR	800	800	0	% 99,954000	799.632,00	1,27	
0,058000000% Banco Santander S.A. EO-FLR Notes 2004(09/Und.)	XS0202197694		EUR	500	0	0	% 96,574500	482.872,50	0,77	
4,125000000% Banco Santander S.A. EO-FLR Nts 2021(27/Und.)	XS2342620924		EUR	400	400	0	% 102,850000	411.400,00	0,65	
2,375000000% Bayer AG FLR-Sub. Anl.v.2015(2022/2075)	DE000A14J611		EUR	1.000	0	0	% 101,744638	1.017.446,38	1,62	
8,500000000% Bca Monte dei Paschi di Siena EO-FLR MTN 2020(25/30)	XS2228919739		EUR	700	200	0	% 92,896000	650.272,00	1,03	
1,457000000% BNP Paribas Fortis S.A. EO-FLR CV.Nts 07(Und.)	BE0933899800		EUR	1.500	0	0	% 92,119000	1.381.785,00	2,20	
5,250000000% Caixabank S.A. EO-FLR Notes 2018(26/Und.)	ES0840609012		EUR	800	0	0	% 107,503000	860.024,00	1,37	
0,000000000% Crédit Agricole S.A. EO-FLR Obl. 2005(15/Und.)	FR0010161026		EUR	1.000	0	0	% 96,898000	968.980,00	1,54	
6,000000000% Deutsche Bank AG FLR-Nachr. Anl.v.14(22/unb.)	DE000DB7XHP3		EUR	1.400	800	0	% 102,114000	1.429.596,00	2,27	
4,382000000% Deutsche Lufthansa AG FLR-Sub. Anl.v.2015(2021/2075)	XS1271836600		EUR	600	200	600	% 97,644000	585.864,00	0,93	
5,750000000% Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr. FLR-MTN 18/und.	XS1808862657		EUR	1.200	200	0	% 104,434000	1.253.208,00	1,99	
3,750000000% Deutsche Postbank EO-FLR 04/09	DE000A0DHUM0		EUR	1.600	400	0	% 101,688000	1.627.008,00	2,59	
1,875000000% EDP - Energias de Portugal SA EO-FLR Securities 2021(26)/81	PTEDPROM0029		EUR	200	200	0	% 100,547000	201.094,00	0,32	
5,375000000% Electricité de France EO-FLR MTN 13/25	FR0011401751		EUR	1.000	0	0	% 112,391000	1.123.910,00	1,79	
3,375000000% ENEL S.p.A. EO-FLR Cap. Secs 2018(26/81)	XS1713463559		EUR	600	0	0	% 110,889000	665.334,00	1,06	
2,000000000% ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2021(47)	XS2334852253		EUR	400	400	0	% 99,979000	399.916,00	0,64	
2,750000000% ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2021(50)	XS2334857138		EUR	400	400	0	% 100,699625	402.798,50	0,64	
2,125000000% Evonik Industries AG FLR-Nachr.-Anl. v.17(22/77)	DE000A2GSFF1		EUR	500	0	0	% 101,752000	508.760,00	0,81	
7,000000000% GRENKE AG FLR-Subord. Bond v.17(23/unb.)	XS1689189501		EUR	200	0	0	% 100,846000	201.692,00	0,32	
0,625000000% Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2019(25)	XS2078696866		EUR	200	0	0	% 92,159000	184.318,00	0,29	

Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
4,750000000% HSBC Holdings PLC EO-FLR MTN 2017(29/Und.)	XS1640903701		EUR	1.000	0	0	% 113,375000	1.133.750,00	1,80
0,460000000% ING Groep N.V. EO-FLR Bonds 2003(13/Und.)	NL0000113587		EUR	1.300	0	200	% 97,644500	1.269.378,50	2,02
7,750000000% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Notes 2017(27/Und.)	XS1548475968		EUR	800	0	0	% 122,448500	979.588,00	1,56
0,185000000% Jyske Bank A/S EO-FLR Med.-T.Nts 05(15/Und.)	XS0212590557		EUR	400	400	0	% 99,855000	399.420,00	0,63
4,500000000% LANXESS AG FLR-Sub.Anl. v.2016(2023/2076)	XS1405763019		EUR	600	0	0	% 106,932000	641.592,00	1,02
3,000000000% LUFTHANSA AG 20/26	XS2265369657		EUR	800	400	0	% 101,644500	813.156,00	1,29
3,500000000% Nordea Bank Abp EO-FLR Cap.MTN 2017(25/Und.)	XS1725580465		EUR	600	0	0	% 105,066000	630.396,00	1,00
1,375000000% Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	FR0014003B55		EUR	200	200	0	% 98,709000	197.418,00	0,31
5,375000000% Porr AG EO-Var. Schuldv. 2020(25/Und.)	XS2113662063		EUR	300	0	0	% 90,520000	271.560,00	0,43
2,625000000% POSTE ITAL 21/29 MTN	XS2353073161		EUR	1.000	1.000	0	% 100,004000	1.000.040,00	1,59
2,625000000% RCI Banque S.A. EO-FLR MTN 2019(25/30)	FR0013459765		EUR	500	0	0	% 100,810000	504.050,00	0,80
2,375000000% Renault S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/26)	FR0014000NZ4		EUR	400	0	0	% 101,641500	406.566,00	0,65
0,470000000% Rothschild&Co Cont.Finance PLC EO-FLR Notes 2004(14/Und.)	XS0197703118		EUR	720	0	0	% 88,485500	637.095,60	1,01
3,500000000% RWE AG FLR-Sub.Anl. v.2015(2025/2075)	XS1219499032		EUR	400	0	0	% 107,355000	429.420,00	0,68
0,875000000% Ryanair DAC EO-Medium-Term Notes 2021(26)	XS2344385815		EUR	200	200	0	% 100,658500	201.317,00	0,32
2,187840000% Stichting AK Rabobank Cert. EO-FLR-Certs 14/Und.	XS1002121454		EUR	1.450	400	0	% 134,936000	1.957.212,95	3,11
3,875000000% Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2018(26/Und.)	XS1795406658		EUR	400	0	0	% 107,814000	431.256,00	0,69
1,625000000% TotalEnergies S.E. EO-FLR MTN 21(21/Und.)	XS2290960520		EUR	200	200	0	% 100,205000	200.410,00	0,32
3,250000000% UNIQA Insurance Group AG EO-FLR Bonds 2020(35)	XS2199567970		EUR	200	0	0	% 108,482500	216.965,00	0,34
3,000000000% Vattenfall AB EO-FLR Cap. Secs 2015(27/77)	XS1205618470		EUR	200	0	0	% 107,915500	215.831,00	0,34
7,750000000% Volksbank Wien AG EO-FLR Notes 2019(24/Und.)	AT000B121991		EUR	200	0	0	% 111,176500	222.353,00	0,35
3,500000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2015(30/Und.)	XS1206541366		EUR	200	0	0	% 110,042000	220.084,00	0,35
3,875000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2017(27/Und.)	XS1629774230		EUR	1.200	0	0	% 110,844333	1.330.132,00	2,11
3,500000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(25/Und.)	XS2187689034		EUR	500	0	0	% 108,282333	541.411,67	0,86
3,875000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	XS2187689380		EUR	700	200	0	% 111,350900	779.456,30	1,24
4,125000000% Wüstenrot Bausparkasse AG Nachrang IHS v.17(27)	DE00WBPOA20		EUR	300	0	0	% 110,000500	330.001,50	0,52
0,625000000% Scandinavian Airlines System SF-Anl. 1986(91/Und.)	CH0006125253		CHF	7.000	1.400	0	% 22,250000	1.420.882,18	2,26
2,500000000% Vattenfall AB LS-FLR Notes 2021(21/83)	XS2355631693		GBP	200	200	0	% 100,737500	234.109,92	0,37
1,425000000% AEGON FLR 96/08/und.	NL0000121416		NLG	480	0	0	% 94,000000	204.745,63	0,33
1,506000000% AEGON N.V. FL-Anleihe 1995(05/Und.)	NL0000120004		NLG	20	0	0	% 95,660000	8.681,72	0,01
0,496000000% AEGON N.V. FL-Anleihe 1996(11/Und.)	NL0000120889		NLG	985	0	0	% 86,000000	384.397,22	0,61
1,774000000% AEGON N.V. DL-FLR Nts 2004(14/Und.)	NL0000116168		USD	600	200	0	% 92,528500	466.334,31	0,74
0,277880000% BNP Paribas S.A. DL-FLR-Notes 1986(91/Und.)	FR0008131403		USD	500	0	0	% 94,300000	396.052,08	0,63
7,250000000% Credit Suisse Group AG DL-FLR Bds 2018(25/Und.) Reg.S	USH3698DBZ62		USD	800	0	0	% 113,249500	761.021,42	1,21

Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
4,000000000% Goldman Sachs Capital II DL-FLR Pref.Secs 2007(12/Und.)	US381427AA15		USD	300	0	0	% 98,775000	248.908,02	0,40
6,250000000% Rakuten Inc. DL-FLR Nts 2021(21/UND.) Reg.S	USJ6S87BAX69		USD	200	200	0	% 108,261000	181.874,84	0,29
6,875000000% UBS Group AG DL-FLR Bonds 2015(25/Und.)	CH0286864027		USD	600	0	0	% 114,131000	575.208,74	0,91
4,625000000% Achmea B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 19(19/Und.)	XS2056490423		EUR	1.600	200	0	% 108,423000	1.734.768,00	2,76
2,625000000% ALLIANZ SUB 20(31)/und	DE000A289FK7		EUR	600	400	0	% 100,873000	605.238,00	0,96
3,250000000% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Cap. Sec.2019(26/Und.)	XS2050933972		EUR	1.000	0	0	% 103,658500	1.036.585,00	1,65
3,100000000% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Medium-Term Notes 2021(28)	XS2332245377		EUR	200	200	0	% 101,335500	202.671,00	0,32
4,625000000% Deutsche Bank AG Med.Term Nts.v.2021(2028)	DE000DL19VZ9		EUR	400	400	0	% 104,221000	416.884,00	0,66
2,625000000% Heimstaden Bostad AB EO-FLR Notes 2021(21/Und.)	XS2294155739		EUR	400	400	0	% 99,009500	396.038,00	0,63
4,000000000% IKB Deutsche Industriebank AG Nachr.-MTN-IHSv.17(27)	DE000A2E4Q88		EUR	927	407	0	% 108,716500	1.007.801,96	1,60
4,500000000% IKB Deutsche Industriebank AG Nachr. Anleihe v. v.2017(2022)	DE000A2E4QG3		EUR	1.000	0	0	% 104,060500	1.040.605,00	1,65
3,625000000% Infineon Technologies AG Sub.-FLR-Nts.v.19(28/und.)	XS2056730679		EUR	1.000	0	0	% 110,114000	1.101.140,00	1,75
4,750000000% Jyske Bank A/S EO-FLR Bonds 2017(27/Und.)	XS1577953331		EUR	400	0	0	% 109,541500	438.166,00	0,70
3,957000000% Mitsub. UFJ Invest.Ser.Bk.Dep. EO-FLR Exch. Notes 2009(50)	XS0413650218		EUR	3.800	1.400	0	% 51,995000	1.975.810,00	3,14
4,000000000% Otto (GmbH & Co KG) Sub.-FLR-Nts.v.18(25/und.)	XS1853998182		EUR	500	0	0	% 107,221000	536.105,00	0,85
4,250000000% Rakuten Group Inc. 21(27)/und	XS2332889778		EUR	800	800	0	% 103,246500	825.972,00	1,31
2,500000000% Repsol Intl Finance B.V. EO-FLR Notes 2021(27/Und.)	XS2320533131		EUR	200	200	0	% 100,734500	201.469,00	0,32
2,624000000% Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB EO-FLR Cap. 2020(25/Und.)	XS2010032618		EUR	700	0	0	% 100,522500	703.657,50	1,12
2,625000000% Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB Namn-Aktier Serie D o.N. 2020(26)/und	XS2272358024		EUR	500	0	0	% 100,315000	501.575,00	0,81
2,875000000% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-FLR 2019/und	XS2056371334		EUR	600	0	0	% 102,887500	617.325,00	0,99
8,000000000% Barclays Bank PLC DL-FLR Securit. 2019(24/Und.)	US06738EBG98		USD	1.000	0	0	% 114,187500	959.155,82	1,53
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	54.935.008,26	87,31
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
5,250000000% Banco Santander S.A. EO-FLR Nts 2017(23/Und.)	XS1692931121		EUR	1.000	200	0	% 106,102500	1.061.025,00	1,69
4,250000000% Commerzbank AG Sub.Fix to Reset MTN21(28/und)	DE000CZ45WA7		EUR	600	600	0	% 101,457000	608.742,00	0,97
2,376000000% Telefónica Europe B.V. EO-Obl. 21/29	XS2293060658		EUR	600	600	0	% 97,935000	587.610,00	0,93
0,750000000% Kon. Luchtvaart Mij. N.V. SF-FLR Anl. 1985(95/Undated)	CH0005362055		CHF	420	0	0	% 26,928500	103.179,04	0,16
4,875000000% Deutsche Bank AG FLR-Sub.Anl. v.2017(2027/2032)	US251526BN89		USD	200	0	0	% 107,905000	181.276,77	0,29
1,155880000% JPMorgan Chase & Co. DL-FLR Cap.E.Nts 17(18/47.77)W	US48123UAB08		USD	800	800	0	% 85,500000	574.548,51	0,91
6,250000000% Norddeutsche Landesbank -GZ- Nachr. DL-IHS.S.1748 v.14/24	XS1055787680		USD	3.000	1.200	0	% 106,481500	2.683.280,13	4,26
5,300000000% Tesla Inc. DL-Notes 2017(17/25) Reg.S	USU8810LAA18		USD	100	0	0	% 103,137000	86.633,35	0,14
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere							EUR	5.886.294,80	9,35
Summe Wertpapiervermögen							EUR	60.821.303,06	96,66

Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2021	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)									
Zinsderivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Zinsterminkontrakte									
Euro Bund Futures 08.09.2021		XEUR	EUR	-500.000				-7.900,00	-0,01
Euro Bund Futures 08.09.2021		XEUR	EUR	-2.000.000				-7.600,00	-0,01
Summe der Zinsderivate							EUR	-15.500,00	-0,02
Devisen-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Verkauf)									
Offene Positionen									
USD/EUR 1,00 Mio.		OTC						-21.913,51	-0,03
Summe der Devisen-Derivate							EUR	-21.913,51	-0,03
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	1.707.753,60				1.707.753,60	2,71
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			CHF	548,09				500,01	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			TRY	64,12				6,18	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			USD	344,07				289,01	0,00
Summe der Bankguthaben							EUR	1.708.548,80	2,71
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	648.664,70				648.664,70	1,03
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	648.664,70	1,03
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-221.205,24			EUR	-221.205,24	-0,35
Fondsvermögen							EUR	62.919.897,81	100 2)
D&R Zins Strategie I									
Anteilwert							EUR	115,05	
Umlaufende Anteile							STK	546.911	

Fußnoten:

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

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 35.827.713,78 EUR.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)			per 30.06.2021	
Schweizer Franken		CHF	1,096150	= 1 Euro (EUR)
Britisches Pfund		GBP	0,860600	= 1 Euro (EUR)
Niederländischer Gulden		NLG	2,203710	= 1 Euro (EUR)
Neue Türkische Lira		TRY	10,368000	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar		USD	1,190500	= 1 Euro (EUR)
Marktschlüssel				
b) Terminbörsen				
XEUR		EUREX DEUTSCHLAND		
c) OTC				
		Over-the-Counter		

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen: Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzugang zum Berichtsstichtag)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
4,250000000% Aareal Bank AG 14/26	DE000A1TNC94	EUR	-	274	
3,750000000% Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2014(2024/2074)	DE000A11QR73	EUR	-	200	
4,000000000% Commerzbank AG T2 Nachr.MTN S.865 v.2016(26)	DE000CZ40LD5	EUR	-	150	
4,000000000% Commerzbank AG T2 Nachr.MTN S.874 v.2017(27)	DE000CZ40LW5	EUR	-	400	
1,961797752% DZ BANK EO-FLR Tr.Pref.Sec. 03/08/Und.	DE0009078337	EUR	-	100	
1,073000000% DZ BANK Cap. Funding Tr. II EO-FLR Tr.Pref. Sec.04/11 U.	DE000A0DCXA0	EUR	-	25	
3,625000000% EnBW Energie Baden-Württem. FLR-Anl. 14/76	XS1044811591	EUR	-	300	
2,875000000% Infineon Technologies AG Anleihe v.2019(2025)/und	XS2056730323	EUR	-	100	
6,750000000% Société Générale S.A. EO-FLR-MTN 2014(21/Und.)	XS0867620725	EUR	-	1.000	
2,995000000% TenneT Holding EO-FLR-Nts 17/24/Und.	XS1591694481	EUR	-	500	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
1,750000000% Deutsche Bk Capital Fin. Tr. I EO-FLR Tr. Pr.Sec.2005(15/Und.)	DE000A0E5JD4	EUR	-	800	
2,125000000% TotalEnergies SE EO-FLR MTN 21(21/Und.)	XS2290960876	EUR	100	100	
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Zinsterminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte:					
Basiswert: Bundesrep.Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe		EUR			6.988,45

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR 4.301.750,00

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 %)	96,66
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,05

Sonstige Angaben

D&R Zins Strategie I

Anteilwert	EUR	115,05
Umlaufende Anteile	STK	546.911

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 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

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