

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

HALBJAHRESBERICHT

D&R Zins Strategie

30. Juni 2022



DONNER & REUSCHEL
PRIVATBANK SEIT 1798

HANSAINVEST

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

Hamburg, im August 2022

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

D&R Zins Strategie

in der Zeit vom 01. Januar 2022 bis 30. Juni 2022.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von - 14,42 % 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

SO BEHALTEN SIE DEN ÜBERBLICK

VERMÖGENSÜBERSICHT ZUM 30. JUNI 2022	4
VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022	5
ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV	11
KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT, VERWAHRSTELLE UND GREMIEN	12

VERMÖGENSÜBERSICHT ZUM 30. JUNI 2022

Fondsvermögen:	EUR 73.498.319,38	(86.640.801,42)
Umlaufende Anteile: I-Klasse	775.596	(764.176)

VERMÖGENSAUFTEILUNG IN TEUR/%

	Kurswert in Fondswährung	% des Fondsvermögens	% des Fondsvermögens per 31.12.2021
I. Vermögensgegenstände			
1. Anleihen	68.818	93,63	(92,55)
2. Derivate	-26	-0,04	(0,09)
3. Bankguthaben	3.879	5,28	(6,35)
4. Sonstige Vermögensgegenstände	918	1,25	(1,26)
II. Verbindlichkeiten	-91	-0,12	(-0,25)
III. Fondsvermögen	73.498	100,00	

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	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 %	86,656500	173.313,00	0,24
4,000000000% AEGON N.V. EO-FLR MTN 2014(24/44)	XS1061711575		EUR	200	0	0 %	99,501000	199.002,00	0,27
3,000000000% Air France-KLM S.A. EO-Obl. 2021(21/24)	FR0014004AE8		EUR	200	0	0 %	93,558000	187.116,00	0,25
2,625000000% ALLIANZ SUB 20(31)/und	DE000A289FK7		EUR	1.000	0	0 %	72,937500	729.375,00	0,99
4,596000000% Assicurazioni Generali S.p.A. EO-FLR MTN 14(25/Und.)	XS1140860534		EUR	1.000	0	0 %	97,357500	973.575,00	1,32
2,250000000% Athora Netherlands NV 21/31	XS2330501995		EUR	300	0	0 %	86,099500	258.298,50	0,35
3,000000000% AXA EO-FLR-MTN 05/10/Und.	XS0210434782		EUR	700	0	0 %	99,251000	694.757,00	0,95
1,612000000% AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 04(09/Und.)	XS0203470157		EUR	1.400	0	0 %	84,196000	1.178.744,00	1,60
2,875000000% Banco BPM S.p.A. EO-FLR MTN 2021(26/31)	XS2358835036		EUR	800	0	0 %	85,639500	685.116,00	0,93
1,265000000% Banco Santander S.A. EO-FLR Notes 2004(09/Und.)	XS0202197694		EUR	500	0	0 %	78,608000	393.040,00	0,53
4,125000000% Banco Santander S.A. EO-FLR Nts 2021(27/Und.)	XS2342620924		EUR	400	0	0 %	76,435500	305.742,00	0,42
8,500000000% Bca Monte dei Paschi di Siena EO-FLR MTN 2020(25/30)	XS2228919739		EUR	900	0	0 %	66,321500	596.893,50	0,81
1,828000000% BNP Paribas Fortis S.A. EO-FLR CV.Nts 07(Und.)	BE0933899800		EUR	1.750	0	0 %	82,875000	1.450.312,50	1,97
0,875000000% BNP Paribas S.A. 21(28)/33	FR0014005U79		EUR	500	0	0 %	78,721956	393.609,78	0,54
3,000000000% British American Tobacco PLC 21/26	XS2391779134		EUR	900	0	0 %	75,331500	677.983,50	0,92
3,750000000% British American Tobacco PLC EO-FLR Notes 2021(29/Und.)	XS2391790610		EUR	1.000	0	0 %	71,829500	718.295,00	0,98
1,000000000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 14/24	DE0001102366		EUR	3.700	3.700	0 %	100,226153	3.708.367,66	5,05
1,750000000% Bundesrep.Deutschland Anl.v.2014 (2024)	DE0001102333		EUR	1.200	1.200	0 %	101,755833	1.221.070,00	1,66
5,250000000% Caixabank S.A. EO-FLR Notes 2018(26/Und.)	ES0840609012		EUR	800	0	0 %	86,419500	691.356,00	0,94
1,250000000% Daimler Truck International Finance (22/25)	XS2466172280		EUR	1.000	1.000	0 %	96,332574	963.325,74	1,31
4,625000000% Deutsche Bank AG Med.Term Nts.v.2021(2028)	DE000DL19VZ9		EUR	400	0	0 %	78,302000	313.208,00	0,43
4,382000000% Deutsche Lufthansa AG FLR-Sub. Anl.v.2015(2021/2075)	XS1271836600		EUR	2.800	0	0 %	81,050000	2.269.400,00	3,09
2,000000000% Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2021/2024)	XS2363244513		EUR	200	0	0 %	94,366000	188.732,00	0,26
3,500000000% Deutsche Lufthansa AG MTN v.2021(2021/2028)	XS2363235107		EUR	300	0	0 %	76,829500	230.488,50	0,31
1,875000000% EDP - Energias de Portugal SA EO-FLR Securities 2021(26)/81	PTEDPROM0029		EUR	200	0	0 %	81,703000	163.406,00	0,22
5,375000000% Electricité de France EO-FLR MTN 13/25	FR0011401751		EUR	1.000	0	0 %	92,560000	925.600,00	1,26
1,375000000% EnBW Energie Baden-Württemberg AG 21(28)/81	XS2381272207		EUR	200	0	0 %	74,547000	149.094,00	0,20
3,375000000% ENEL S.p.A. EO-FLR Cap. Secs 2018(26/UN)	XS1713463559		EUR	600	0	0 %	88,792875	532.757,25	0,72
2,875000000% Eurofins Scientific S.E. EO-FLR Notes 2019(22/Und.)	XS2051471105		EUR	1.500	1.500	0 %	99,749500	1.496.242,50	2,04

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
1,375000000% Evonik Industries AG 21(26)/81	DE000A3E5WW4		EUR	300	0	0 %	81,811000	245.433,00	0,33
7,000000000% GRENKE AG FLR-Subord. Bond v.17(23/Unb.)	XS1689189501		EUR	200	0	0 %	92,668500	185.337,00	0,25
0,625000000% Grenke Finance PLC EO-Medium-Term Notes 2019(25)	XS2078696866		EUR	200	0	0 %	90,116000	180.232,00	0,25
6,750000000% Heimstaden AB EO-FLR Notes 21(21/Und.)	SE0016278352		EUR	500	0	0 %	62,008000	310.040,00	0,42
2,625000000% Heimstaden Bostad AB EO-FLR Notes 2021(21/Und.)	XS2294155739		EUR	400	0	0 %	53,564500	214.258,00	0,29
7,750000000% Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Notes 2017(27/Und.)	XS1548475968		EUR	800	0	0 %	96,240000	769.920,00	1,05
3,000000000% La Banque Postale EO-FLR Notes 2021(28/Und.)	FR0014005090		EUR	1.800	0	200 %	67,185500	1.209.339,00	1,65
3,000000000% LUFTHANSA AG 20/26	XS2265369657		EUR	800	0	0 %	85,393500	683.148,00	0,93
3,500000000% Nordea Bank Abp EO-FLR Cap.MTN 2017(25/Und.)	XS1725580465		EUR	600	0	0 %	93,087000	558.522,00	0,76
2,625000000% RCI Banque S.A. EO-FLR MTN 2019(25/30)	FR0013459765		EUR	500	0	0 %	88,048000	440.240,00	0,60
2,375000000% Renault S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/26)	FR0014000N24		EUR	400	0	0 %	86,222500	344.890,00	0,47
1,860000000% Rothschild&Co Cont.Finance PLC EO-FLR Notes 2004(14/Und.)	XS0197703118		EUR	720	0	0 %	70,896500	510.454,80	0,69
3,500000000% RWE AG FLR-Sub.Anl. v.2015(2025/2075)	XS1219499032		EUR	600	0	0 %	98,394500	590.367,00	0,80
6,500000000% Stichting AK Rabobank Cert. EO-FLR-Certs 14/Und.	XS1002121454		EUR	1.450	0	0 %	98,240500	1.424.953,89	1,94
3,875000000% Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2018(26/Und.)	XS1795406658		EUR	400	0	0 %	90,924000	363.696,00	0,49
1,625000000% TotalEnergies S.E. EO-FLR MTN 21(21/Und.)	XS2290960520		EUR	200	0	0 %	81,199000	162.398,00	0,22
3,250000000% UNIQA Insurance Group AG EO-FLR Bonds 2020(35)	XS2199567970		EUR	200	0	0 %	93,362000	186.724,00	0,25
3,000000000% Vattenfall AB EO-FLR Cap. Secs 2015(27/77)	XS1205618470		EUR	200	0	0 %	88,844916	177.689,83	0,24
3,500000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2015(30/Und.)	XS1206541366		EUR	200	0	0 %	83,114071	166.228,14	0,23
3,500000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(25/Und.)	XS2187689034		EUR	500	0	0 %	92,153062	460.765,31	0,63
3,875000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	XS2187689380		EUR	1.100	0	0 %	83,977062	923.747,68	1,26
4,125000000% Wüstenrot Bausparkasse AG Nachrang IHS v.17(27)	DE000WBP0A20		EUR	300	0	0 %	104,355000	313.065,00	0,43
0,625000000% Scandinavian Airlines System SF-Anl. 1986(91/Und.)	CH0006125253		CHF	8.920	0	0 %	19,175000	1.713.065,25	2,33
1,425000000% AEGON FLR 96/08/und.	NL0000121416		NLG	480	0	0 %	77,000000	167.717,17	0,23
1,506000000% AEGON N.V. FL-Anleihe 1995(05/Und.)	NL0000120004		NLG	20	0	0 %	90,333000	8.198,27	0,01
0,496000000% AEGON N.V. FL-Anleihe 1996(11/Und.)	NL0000120889		NLG	985	0	0 %	67,600000	302.154,09	0,41
2,802000000% AEGON N.V. DL-FLR Nts 2004(14/Und.)	NL0000116168		USD	600	0	0 %	83,909500	480.489,60	0,65
5,750000000% Argentum Netherlands B.V. DL-FLMTN LPN 15(25/50)Swiss Re	XS1261170515		USD	600	0	0 %	97,374500	557.594,01	0,76
1,574710000% BNP Paribas S.A. DL-FLR-Notes 1986(91/Und.)	FR0008131403		USD	500	0	0 %	74,622000	356.088,95	0,48
0,250000000% Commonwealth Bank of Australia DL-FLR-Notes 1986(92/Und.)	GB0008424284		USD	400	0	0 %	87,625000	334.510,40	0,46

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
7,250000000% Credit Suisse Group AG DL-FLR Bds 2018(25/Und.) Reg.S	USH3698DBZ62		USD	800	0	0 %	88,587500	676.369,54	0,92
4,000000000% Goldman Sachs Capital II DL-FLR Pref.Secs 2007(12/Und.)	US381427AA15		USD	500	0	0 %	71,920000	343.195,27	0,47
3,187500000% HSBC Bank PLC DL-FLR-Notes 1985(90/Und.)	GB0005902332		USD	800	0	0 %	77,375000	590.761,60	0,80
4,875000000% Julius Baer Gruppe AG DL-FLR Bonds 2020(26/Und.)	XS2238020445		USD	600	0	0 %	91,848500	525.950,56	0,72
3,625000000% Julius Baer Gruppe AG DL-FLR Bonds 2021(28/Und.)	XS2387925501		USD	200	0	0 %	75,924500	144.921,74	0,20
6,250000000% Rakuten Inc. DL-FLR Nts 2021(21/UND.) Reg.S	USJ6S87BAX69		USD	200	0	0 %	80,093500	152.879,37	0,21
6,875000000% UBS Group AG DL-FLR Bonds 2015(25/Und.)	CH0286864027		USD	600	0	0 %	98,070500	561.579,50	0,76
5,000000000% AT&S Austria Techn.&Systemt.AG EO-FLR Notes 2022(27/Und.)	XS2432941693		EUR	800	800	0 %	86,888000	695.104,00	0,95
4,500000000% BAYER AG 22/27	XS2451802768		EUR	1.000	1.000	0 %	87,637000	876.370,00	1,19
3,625000000% Infineon Technologies AG Sub.-FLR-Nts.v.19(28/unb.)	XS2056730679		EUR	1.000	0	0 %	88,164500	881.645,00	1,20
4,750000000% Jyske Bank A/S EO-FLR Bonds 2017(27/Und.)	XS1577953331		EUR	400	0	0 %	92,010000	368.040,00	0,50
2,875000000% Telefonica Emisiones S.A.U. EO-FLR 2019/Und	XS2056371334		EUR	600	0	0 %	81,420000	488.520,00	0,66
2,125000000% EnBW Energie Baden-Württemberg AG 21(32)/81	XS2381277008		EUR	200	0	0 %	67,753200	135.506,40	0,18
2,000000000% ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2021(47)	XS2334852253		EUR	400	0	0 %	81,790071	327.160,28	0,45
2,625000000% Poste Italiane S.p.A. EO-FLR MTN 2021(29/Und.)	XS2353073161		EUR	1.200	0	0 %	71,567500	858.810,00	1,17
2,500000000% Repsol Intl Finance B.V. EO-FLR Notes 2021(21/Und.)	XS2320533131		EUR	600	0	0 %	84,079000	504.474,00	0,69
2,376000000% Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 2021(29/Und.)	XS2293060658		EUR	600	0	0 %	71,775000	430.650,00	0,59
0,750000000% Kon. Luchtvaart Mij. N.V. SF-FLR Anl. 1985(95/Undated)	CH0005362055		CHF	420	0	0 %	21,494000	90.414,94	0,12
5,844000000% HSBC Bank Cap.Fdg (Sterl.1) LP LS-FLR Tr.Pref.Secs03(31/Und.)	XS0179407910		GBP	400	0	0 %	114,619000	530.336,61	0,72
0,000000000% SAS AB SK-FLR Notes 2020(Und.)	SE0014957999		SEK	13.000	0	0 %	34,500000	419.566,68	0,57
8,250000000% China Evergrande Group DL-Notes 2017(17/22)	XS1580431143		USD	200	0	0 %	0,000001	0,00	0,00
6,250000000% Norddeutsche Landesbank -GZ- Nachr.DL-IHS.S.1748 v.14/24	XS1055787680		USD	3.600	0	0 %	97,450000	3.348.158,05	4,56
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	49.759.900,36	67,70
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
3,250000000% AGEAS SA/NV EO-FLR Notes 2019(29/49)	BE0002644251		EUR	800	0	0 %	88,703714	709.629,71	0,97
5,250000000% Banco Santander S.A. EO-FLR Nts 2017(23/Und.)	XS1692931121		EUR	1.000	0	0 %	96,111500	961.115,00	1,31
4,250000000% Commerzbank AG EO-FLR-Nachr. Anl.v.21(27/unb.)	DE000CZ45WA7		EUR	1.400	0	0 %	78,088500	1.093.239,00	1,49
4,875000000% Deutsche Bank AG FLR-Sub.Anl. v.2017(2027/2032)	US251526BN89		USD	200	0	0 %	84,857000	161.971,75	0,22
2,411290000% JPMorgan Chase & Co. DL-FLR Cap.E.Nts 17(18/47.77)W	US48123UAB08		USD	800	0	0 %	79,250000	605.077,30	0,82
2,250000000% United States of America DL-Notes 2019(24)	US9128286R69		USD	4.500	4.500	0 %	98,533203	4.231.718,02	5,76

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
4,625000000% Achmea B.V. EO-FLR Med.-T. Nts 19(19/Und.)	XS2056490423		EUR	1.600	0	0 %	84,644000	1.354.304,00	1,84
2,600000000% Allianz 21(32)/und	DE000A3E5TR0		EUR	1.000	0	0 %	69,747000	697.470,00	0,95
3,250000000% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Cap.Sec.2019(26/Und.)	XS2050933972		EUR	1.000	0	0 %	83,243000	832.430,00	1,13
4,000000000% IKB Deutsche Industriebank AG Nachr.-MTN-IHsv.17(27)	DE000A2E4Q88		EUR	927	0	0 %	100,964000	935.936,28	1,27
4,500000000% IKB Deutsche Industriebank AG Nachr.Anleihe v. v.2017(2022)	DE000A2E4QG3		EUR	1.000	0	0 %	99,686000	996.860,00	1,36
4,137000000% Mitsub. UFJ Invest.Ser.Bk.Dep. EO-FLR Exch. Notes 2009(50)	XS0413650218		EUR	4.800	0	0 %	35,340000	1.696.320,00	2,31
4,000000000% Otto (GmbH & Co KG) Sub.-FLR-Nts.v.18(25/und.)	XS1853998182		EUR	500	0	0 %	101,390500	506.952,50	0,69
2,624000000% Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB EO-FLR Cap. 2020(25/Und.)	XS2010032618		EUR	700	0	0 %	34,500000	241.500,00	0,33
2,625000000% Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB Namn-Aktier Serie D o.N. 2020(26)/und	XS2272358024		EUR	500	0	0 %	32,182500	160.912,50	0,22
3,200000000% Allianz 21(28)/und	USX10001AB51		USD	1.400	0	0 %	74,533000	995.859,90	1,35
8,000000000% Barclays Bank PLC DL-FLR Securit. 2019(24/Und.)	US06738EBG98		USD	1.000	0	0 %	99,529500	949.890,25	1,29
5,875000000% QBE Insurance Group Ltd. DL-FLR MTN 2020(25/Und.) Reg.S	USQ78063AJ59		USD	800	0	0 %	96,707000	738.362,28	1,00
6,375000000% HSBC Holdings PLC DL-FLR Cap. Notes 2014(24/Und.)	US404280AS86		USD	800	0	0 %	97,000000	740.599,35	1,01
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere							EUR	18.610.147,84	25,32
Nicht notierte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
5,000000000% Domicil Real Estate AG Pflichtwandelschuld.v. 21(24)	DE000A3MP5T8		EUR	600	0	0 %	74,659517	447.957,10	0,61
Summe der nicht notierten Wertpapiere							EUR	447.957,10	0,61
Summe Wertpapiervermögen							EUR	68.818.005,30	93,63
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Devisen-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Verkauf)									
Offene Positionen									
USD/EUR 2,50 Mio.		OTC						-55.926,66	-0,08
USD/EUR 1,60 Mio.		OTC						-6.216,59	-0,01
USD/EUR 2,30 Mio.		OTC						2.087,72	0,00
USD/EUR 11,60 Mio.		OTC						34.051,09	0,05
Summe der Devisen-Derivate							EUR	-26.004,44	-0,04

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 30. JUNI 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge Ver- käufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
Bankguthaben								
EUR - Guthaben bei:								
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	3.498.377,59			3.498.377,59	4,76
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:								
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			CHF	65.046,48			65.147,46	0,09
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			USD	328.848,92			313.847,03	0,43
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			GBP	1.362,27			1.575,79	0,00
Summe der Bankguthaben						EUR	3.878.947,87	5,28
Sonstige Vermögensgegenstände								
Zinsansprüche			EUR	917.892,40			917.892,40	1,25
Summe sonstige Vermögensgegenstände						EUR	917.892,40	1,25
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-90.521,75		EUR	-90.521,75	-0,12
Fondsvermögen						EUR	73.498.319,38	100,2)
D&R Zins Strategie I								
Anteilwert						EUR	94,76	
Umlaufende Anteile						STK	775.596	

Fußnoten:

1) noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung, 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 110.292.641,75 EUR.

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)		per 30.06.2022	
Schweizer Franken	CHF	0,998450	= 1 Euro (EUR)
Britisches Pfund	GBP	0,864500	= 1 Euro (EUR)
Niederländischer Gulden	NLG	2,203710	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	SEK	10,689600	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,047800	= 1 Euro (EUR)
Marktschlüssel			
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 (MARKTZUORDNUNG ZUM BERICHTSSTICHTAG)

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
3,875000000% Air France-KLM 21/26	FR0014004AF5	EUR	-	1.000	
2,375000000% Bayer AG FLR-Sub.Anl.v.2015(2022/2075)	DE000A14J611	EUR	700	1.700	
3,625000000% Banco Santander S.A. EO-FLR Nts 2021(29/Und.)	XS2388378981	EUR	-	200	
0,000000000% Crédit Agricole S.A. EO-FLR Obl. 2005(15/Und.)	FR0010161026	EUR	-	1.000	
5,750000000% Deutsche Pfandbriefbank AG Nachr.FLR-MTN 18/ und.	XS1808862657	EUR	-	1.200	
2,750000000% ENI S.p.A. EO-FLR Nts 2021(30/Und.)	XS2334857138	EUR	-	400	
4,750000000% HSBC Holdings PLC EO-FLR MTN 2017(29/Und.)	XS1640903701	EUR	-	1.000	
4,500000000% LANXESS AG FLR-Sub.Anl. v.2016(2023/2076)	XS1405763019	EUR	-	600	
5,375000000% Porr AG EO-Var. Schuldv. 2020(25/Und.)	XS2113662063	EUR	-	300	
4,250000000% Rakuten Group Inc. 21(27)/und	XS2332889778	EUR	-	800	
7,750000000% Volksbank Wien AG EO-FLR Notes 2019(24/Und.)	AT000B121991	EUR	-	200	
3,875000000% Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2017(27/Und.)	XS1629774230	EUR	-	1.200	
2,500000000% Vattenfall AB LS-FLR Notes 2021(21/83)	XS2355631693	GBP	-	200	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
2,375000000% Bayer AG z.Ver. FLR-Sub.Anl.15(22/75)	DE000BAY01V7	EUR	1.700	1.700	
3,100000000% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Medium-Term Notes 2021(28)	XS2332245377	EUR	-	200	
6,000000000% Deutsche Bank AG FLR-Nachr.Anl.v.14(22/unb.)	DE000DB7XHP3	EUR	-	1.600	
5,500000000% SIGMA Development Fin.S.C.S. EO-Notes 2021(21/26) Reg.S	DE000A3KS5R1	EUR	-	1.600	
3,750000000% Nordea Bank Abp DL-FLR MTN 2021(29/Und.) Reg.S	US65559D2D05	USD	-	200	
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
FS Colibri Event Driven Bonds Inhaber-Ant. S A EUR o.N.	DE000A2QND20	ANT	800	800	
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			9.388,70
Devisenterminkontrakte (Verkauf)					
Verkauf von Devisen auf Termin:					
USD/EUR		EUR			19.147,25
Optionsrechte auf Zins-Derivate					
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte:					
Gekaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: Euro Bund Futures		EUR			7,43

ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure

EUR 275.787,74

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 %)	93,63
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,04

Sonstige Angaben

D&R Zins Strategie I

Anteilwert	EUR	94,76
Umlaufende Anteile	STK	775.596

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 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 Gruppenfremde Investmentanteile beträgt: FS Colibri Event Driven Bonds Inhaber-Ant. S A EUR o.N. 0,2600 %
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

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.de
E-Mail: service@hansainvest.de

Gezeichnetes Kapital: € 10.500.000,00
Eigenmittel: € 22.659.122,98
(Stand: 31.12.2021)

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. Lagebericht 2021: € 380.667.460,85
(Stand: 31.12.2021)

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 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 Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Hamburg

GESCHÄFTSFÜHRUNG:

Dr. Jörg W. Stotz (Sprecher, zugleich Aufsichtsrats-
vorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied der
Geschäftsführung der HANSAINVEST Real Assets GmbH
sowie Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset
Management AG)

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

Ludger Wibbeke (zugleich stellvertretender
Aufsichtsratsvorsitzender 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

HANSAINVEST