

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

HALBJAHRESBERICHT

Aramea Balanced Convertible

31. Januar 2022

SEHR GEEHRTE ANLEGERIN,
SEHR GEEHRTER ANLEGER,

Hamburg, im März 2022

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

Aramea Balanced Convertible

in der Zeit vom 01. August 2021 bis 31. Januar 2022.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von - 1,67 % in der A-Class, von - 1,56 % in der I-Class sowie von - 1,27 % in der S-Class.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Sondervermögens im Detail per Ende Januar darstellte. Wenn Sie darüber hinaus einen aktuellen Einblick in den Fonds bekommen und unsere Einschätzung der Märkte kennenlernen möchten, besuchen Sie unseren Internetauftritt: Unter www.hansainvest.de veröffentlichen wir regelmäßig einen Kommentar des Fondsmanagements. Abseits dessen stehen wir Ihnen aber auch für weitere Fragen gern zur Verfügung und verbleiben

mit herzlichen Grüßen

Ihre
HANSAINVEST-Geschäftsführung

Dr. Jörg W. Stotz, Nicholas Brinckmann, Ludger Wibbeke

SO BEHALTEN SIE DEN ÜBERBLICK

VERMÖGENSÜBERSICHT ZUM 31. JANUAR 2022	4
VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31. JANUAR 2022	5
ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV	11
KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT, VERWAHRSTELLE UND GREMIEN	12

VERMÖGENSÜBERSICHT ZUM 31. JANUAR 2022

Fondsvermögen:	EUR 162.651.993,79	(152.973.828,40)
Umlaufende Anteile: Class A	456.263	(447.634)
Class I	1.190.945	(960.235)
Class S	1.200.000	(1.200.000)

VERMÖGENSAUFTEILUNG IN TEUR/%

	Kurswert in Fondswährung	% des Fondsvermögens	% des Fondsvermögens per 31.07.2021
I. Vermögensgegenstände			
1. Anleihen	155.071	95,34	(92,25)
2. Derivate	-482	-0,30	(-0,58)
3. Bankguthaben	7.998	4,92	(8,59)
4. Sonstige Vermögensgegenstände	202	0,12	(0,12)
II. Verbindlichkeiten	-137	-0,08	(-0,38)
III. Fondsvermögen	162.652	100,00	

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 31. JANUAR 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
0,0500000000% adidas EO-Wandelanleihe 2018(23)	DE000A2LQRW5		EUR	3.200	1.000	0 %	110,780000	3.544.960,00	2,19
0,7820000000% AgeasFinLux EO-Conv.FLR Nts. Reg.S 02/Und.	XS0147484074		EUR	2.250	500	0 %	91,903000	2.067.817,50	1,28
0,0000000000% Atos CV 19/24	FR0013457942		EUR	2.100	0	0 %	104,100000	2.186.100,00	1,34
1,4110000000% BNP Paribas Fortis S.A. EO-FLR CV.Nts 07(Und.)	BE0933899800		EUR	3.000	500	0 %	95,550000	2.866.500,00	1,76
1,5000000000% Cellnex Telecom S.A. Conv. Notes 2018(26)	XS1750026186		EUR	900	0	600 %	139,640000	1.256.760,00	0,77
0,0500000000% Deutsche Post AG Wandel-schuld.v.17(25)	DE000A2G87D4		EUR	4.700	600	0 %	115,475000	5.427.325,00	3,34
0,0000000000% Electricité de France (E.D.F.) EO-Zo Conv.Med.-T.Bds 2020(24)	FR0013534518		STK	265.000	30.000	0 %	12,200000	3.233.000,00	1,99
0,0000000000% ENI S.p.A. EO-Zo Conv.Notes 16/22	XS1394957309		EUR	1.400	0	0 %	100,174000	1.402.436,00	0,86
0,0000000000% Fresenius SE & Co. KGaA Unverz. Wandelschv. 17/24	DE000A2DAHU1		EUR	1.000	0	0 %	99,675000	996.750,00	0,61
0,0000000000% Geely Sweden Finance AB (publ) EO-Zero Exch. Bonds 2019(24)	XS1933947951		EUR	2.500	300	0 %	129,553000	3.238.825,00	1,99
0,0000000000% Iberdrola International B.V. EO-Conv.-Bonds 2015(22)	XS1321004118		EUR	500	0	0 %	123,750000	618.750,00	0,38
0,0000000000% JPMorgan Chase Bank N.A. EO-Zero Exch.Bonds 2021(24)	XS2303829308		EUR	2.800	0	0 %	109,940000	3.078.320,00	1,89
0,0000000000% Kering S.A. EO-Zero Exchang. MTN 2019(22)	FR0013450483		EUR	1.300	300	0 %	108,363000	1.408.719,00	0,87
0,0000000000% POSCO EO-Notes 2021(26)	XS2376482423		EUR	1.000	1.000	0 %	101,270000	1.012.700,00	0,62
0,0000000000% Schneider Electric SE EO-Zo Sust. Lkd Conv.MTB 20(26)	FR0014000G2		STK	5.000	0	0 %	210,680000	1.053.400,00	0,65
0,0000000000% Snam S.p.A. Conv. 17/22	XS1583310807		EUR	1.600	0	0 %	104,129000	1.666.064,00	1,02
0,0000000000% Cembra Money Bank AG SF-Nullk.-Wdl.-Anl. 2019(26)	CH0486598227		CHF	1.600	0	0 %	97,717000	1.505.437,39	0,93
0,1500000000% Sika AG SF-Wdl.-Anl. 2018(25)	CH0413990240		CHF	2.300	0	300 %	163,731000	3.626.029,56	2,23
1,0000000000% BP Capital Markets PLC EO CV 16/23	XS1410519976		GBP	2.000	0	0 %	106,178000	2.551.435,78	1,57
0,0000000000% Zhongsheng Group Holdings Ltd. HD-Zero Conv. Bonds 2020(25)	XS2171663227		HKD	4.000	0	0 %	140,866000	647.507,20	0,40
0,0000000000% NIPPON STEEL CORPORATION 21/26	XS2387597573		JPY	250.000	250.000	0 %	103,575000	2.013.432,60	1,24
1,5000000000% Bharti Airtel Ltd. DL-Conv.Notes 2020(25) Reg.S	USY0889VAB63		USD	1.600	0	0 %	132,375000	1.896.999,55	1,17
0,0000000000% Carrefour S.A. DL-Zero Exch. Bonds 2018(24)	FR0013326204		USD	800	0	0 %	107,305500	768.870,58	0,47
1,5000000000% China Mengniu Dairy Co. Ltd. DL-Exch.Bds 2020(23)	XS2189122570		USD	300	0	0 %	119,776000	321.834,30	0,20
0,0000000000% Cie Génle Étis Michelin SCpA DL-Exchangeable Bonds 2018(23)	FR0013309184		USD	1.400	400	0 %	103,930000	1.303.197,49	0,80
0,0000000000% Glencore Funding LLC DL-Zero Exch. Bonds 2018(25)	XS1799614232		USD	2.400	0	0 %	104,480000	2.245.875,50	1,38
3,3750000000% Lenovo Group Ltd. DL-Notes 2019(24)	XS1937306121		USD	1.200	0	0 %	136,383000	1.465.827,14	0,90
0,0000000000% Meituan CV 21/28	XS2333569056		USD	1.500	0	0 %	91,091000	1.223.793,10	0,75
1,0000000000% Qiagen N.V. DL-Exchangeable Notes 18/24	XS1908221507		USD	2.400	0	0 %	117,271000	2.520.827,59	1,55
0,0000000000% Qiagen N.V. DL-Zero Exch. Bonds 20/27	DE000A286LP0		USD	1.000	1.000	0 %	99,912000	894.867,89	0,55

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 31. JANUAR 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2022	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
0,000000000% STMicroelectronics N.V. DL-Zero Conv. Nts 2020(27) A	XS2211997239		USD	2.400	400	0 %	123,385000	2.652.252,58	1,63
0,500000000% TotalEnergies SE DL-Conv. Obl. 15/22	XS1327914062		USD	4.000	600	0 %	106,650000	3.820.868,79	2,35
Summe der börsengehandelten Wertpapiere							EUR	64.517.483,54	39,68
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
0,750000000% Cellnex Telecom S.A. EO CV 20/31	XS2257580857		EUR	1.300	300	0 %	91,597000	1.190.761,00	0,73
0,000000000% Oliver Capital S.à r.l. EO-Zero Exch. Bonds 20/23	XS2240512124		EUR	3.300	1.000	0 %	113,288000	3.738.504,00	2,30
0,000000000% ADM AG Holding 20/23	XS2220527001		USD	1.400	400	0 %	103,000000	1.291.536,05	0,79
4,625000000% Ares Capital Corp. DL-Exch. Notes 2019(24)	US04010LAW37		USD	1.600	0	0 %	116,627000	1.671.322,88	1,03
0,000000000% Barclays Bank PLC DL-Zo Equity Lkd Ex.MTN 20(25)	US06738G8A15		USD	1.400	0	0 %	153,897956	1.929.754,93	1,19
0,000000000% Barclays Bank PLC DL-Zo Equity Lkd Ex.MTN 20(25)	US06739GCF46		USD	1.800	400	0 %	107,830515	1.738.422,99	1,07
0,925000000% BASF SE O.Anl.v.2017(2023) mO(A2BPEW)	DE000A2BPEU0		USD	3.250	0	0 %	99,878000	2.907.330,94	1,79
0,750000000% Booking Holdings Inc. DL-Conv. Notes 2020(25)	US09857LAN82		USD	1.000	0	0 %	146,018000	1.307.819,08	0,80
0,750000000% Euronet Worldwide Inc. DL-Exch. Notes 2020(49)	US298736AL30		USD	2.400	400	0 %	110,728000	2.380.180,92	1,46
0,000000000% Expedia Group Inc. DL-Notes 21/26	US30212PBD69		USD	1.800	0	0 %	113,772000	1.834.210,48	1,13
4,500000000% Goldman Sachs BDC Inc. DL-Conv. Nts 2016(22)	US38147UAB35		USD	1.500	0	0 %	101,159000	1.359.055,08	0,84
0,000000000% Hon Hai Precision Industry CV 21/26	XS2363250759		USD	1.000	1.000	0 %	100,625000	901.253,92	0,55
0,000000000% Illumina Inc. DL-Zo Conv.Nts 2018(23)	US452327AK54		USD	1.800	0	0 %	106,687500	1.719.995,52	1,06
0,125000000% JPMorgan Chase Bank N.A. DL-Equ. Lkd Exch. Nts 2020(23)	US48128DAC11		USD	400	0	0 %	99,200000	355.396,33	0,22
0,250000000% JPMorgan Chase Finl Co. LLC DL-Equ.Lkd Ex.Nts 2018(23)144A	US48129KAE01		USD	500	0	0 %	112,450000	503.582,62	0,31
0,250000000% Pioneer Natural Resources Co. DL-Exch. Notes 2021(25)	US723787AP23		USD	1.500	0	0 %	202,326000	2.718.217,64	1,67
6,375000000% Prospect Capital Corp. DL-Conv. Notes 2020(25)	US74348TAT97		USD	1.400	1.000	0 %	108,625000	1.362.068,97	0,84
1,250000000% Southwest Airlines Co. DL-Exch. Notes 2020(25)	US844741BG22		USD	800	0	0 %	132,285000	947.854,90	0,58
0,000000000% Universe Trek Limited CV 21/26	XS2349508866		USD	1.600	800	0 %	93,625000	1.341.692,79	0,82
1,500000000% Western Digital Corp. DL-Conv. Notes 2018(24)	US958102AP07		USD	2.000	500	0 %	99,375000	1.780.116,44	1,09
1,500000000% Amadeus IT Group S.A. EO-Med.-T. Nts 2020/25 CV	XS2154448059		EUR	1.300	0	0 %	133,490000	1.735.370,00	1,07
0,000000000% América Móvil S.A.B. de C.V. DL-Notes 2021(21/24)	XS2308171383		EUR	3.600	600	0 %	104,863000	3.775.068,00	2,32
0,500000000% Cellnex Telecom S.A. EO-Conv. Med.-Term Bds 2019(28)	XS2021212332		EUR	2.000	0	0 %	119,780000	2.395.600,00	1,47
0,500000000% Citigroup Gl.M.Fdg Lux. S.C.A. EO-Exch.MTN 16/23	XS1466161350		EUR	2.800	0	0 %	112,188000	3.141.264,00	1,93
0,000000000% Edenred S.A. CV 21/28	FR0014003YP6		STK	11.000	3.000	0 %	63,683000	700.513,00	0,43
0,000000000% Edenred S.A. OCEANE 19/24	FR0013444395		STK	21.000	3.000	0 %	60,924000	1.279.404,00	0,79
0,000000000% Elliott Capital S.à.r.l. EO-Zero Exch. Bonds 2019(22)	XS2051856669		EUR	1.000	0	0 %	100,525000	1.005.250,00	0,62

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 31. JANUAR 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2022	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
0,000000000% GN Store Nord AS EO-Zero Bonds 2019(24) wW	XS1965536656		EUR	2.000	0	0 %	108,761000	2.175.220,00	1,34
0,250000000% Grand City Properties S.A. EO-Conv. Bonds 2016(22)	XS1373990834		EUR	1.200	0	0 %	100,235000	1.202.820,00	0,74
0,000000000% JPMorgan Chase Finl Co. LLC EO-Zo Exch.Med.-T.Nts 2022(25)	XS2431434971		EUR	2.300	2.300	0 %	108,725000	2.500.675,00	1,54
0,000000000% JPMorgan Exchang.Bond LVMH 21/24	XS2352315571		EUR	2.000	0	0 %	113,640000	2.272.800,00	1,40
0,400000000% LEG Immobilien AG Wandel- schuld.v. 20/28	DE000A289T23		EUR	1.500	0	0 %	102,370000	1.535.550,00	0,94
0,875000000% LEG Immobilien AG Wandel- schuld.v.17(22/25)	DE000A2GSDH2		EUR	1.400	0	0 %	117,904000	1.650.656,00	1,01
0,050000000% MTU Aero Engines AG Wandel- schuld.v.19/27	DE000A2YPE76		EUR	1.500	0	0 %	96,855000	1.452.825,00	0,89
0,125000000% Rémy Cointreau S.A. EO-Obl. Conv. 2016(21/26)	FR0013200995		STK	9.600	0	0 %	188,321000	1.807.881,60	1,11
0,625000000% TAG Immobilien AG Wandel- schuld.v.20(24/26)	DE000A3E46Y9		EUR	1.500	0	0 %	100,736500	1.511.047,50	0,93
0,000000000% Veolia Environnement S.A. EO-Zero Conv. Bonds 2019(25)	FR0013444148		STK	132.000	30.000	0 %	37,054000	4.891.128,00	3,01
0,000000000% Worldline S.A. EO-Zero Conv. Bonds 19/26	FR0013439304		STK	11.000	0	0 %	98,313000	1.081.443,00	0,66
0,000000000% Worldline S.A. EO-Zero Conv. Bonds 20/25	FR0013526803		STK	10.000	0	0 %	115,745000	1.157.450,00	0,71
2,300000000% Dexus Finance Pty. Ltd. AD-Exch. Bonds 2019(26)	XS1961891220		AUD	1.700	0	0 %	100,163000	1.066.999,40	0,66
1,500000000% Derwent Ldn Cap.No.3 (JE) Ltd. LS-Conv. Notes 2019(25)	XS2010324585		GBP	2.000	0	0 %	101,910000	2.448.876,61	1,51
0,000000000% Citigroup Gl.M.Fdg Lux. S.C.A. HD-Zero Exch. MTN 2020(24)	XS2133036603		HKD	10.000	0	0 %	114,380000	1.314.402,93	0,81
1,875000000% Brenntag Finance B.V. DL-Bonds 2015(22) wW	DE000A1Z3XP8		USD	3.000	500	0 %	112,175000	3.014.106,58	1,85
0,000000000% Carrefour S.A. DL-Zero Exch. Bonds 17/23	FR0013261062		USD	800	0	0 %	98,721000	707.360,50	0,43
0,000000000% GlaxoSmithKline PLC CV 2020(23/23)	US36259RAA05		USD	400	0	0 %	97,375000	348.858,04	0,21
0,000000000% JPMorgan Chase Bank N.A. DL-Zero Exch.Bonds 2019(22)	XS2038088527		USD	500	0	0 %	113,125000	506.605,46	0,31
0,000000000% STMicroelectronics N.V. DL-Zero Conv. Nts 2020(25) A	XS2211997155		USD	2.400	400	0 %	124,050000	2.666.547,25	1,64
Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere							EUR	82.324.799,35	50,60
Nicht notierte Wertpapiere									
Verzinsliche Wertpapiere									
0,000000000% Engie S.A. EO-Zo Exch.MTN 21/24	FR0014003RF1		STK	31.000	19.000	0 %	92,255000	2.859.905,00	1,76
0,000000000% Mondelez International Holdings CV 21/24	XS2388456456		EUR	1.600	1.600	0 %	104,320000	1.669.120,00	1,03
0,000000000% Sagerpar S.A. EO-Obl.Conv. Notes 21/26	BE6327660591		EUR	2.000	500	0 %	105,293000	2.105.860,00	1,29
0,000000000% Citigroup Gl.M.Fdg Lux. S.C.A. HD-Zero Exch. MTN 2021(24)	XS2344373134		HKD	6.000	6.000	0 %	102,750000	708.453,76	0,44
0,000000000% Ping An Insurance 20/23	XS2264505566		USD	1.000	0	0 %	98,772000	884.657,41	0,54
Summe der nicht notierten Wertpapiere							EUR	8.227.996,17	5,06
Summe Wertpapiervermögen							EUR	155.070.279,06	95,34

VERMÖGENAUFSTELLUNG ZUM 31. JANUAR 2022

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.01.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Devisen-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
Devisenterminkontrakte (Verkauf)									
Offene Positionen									
USD/EUR 42,80 Mio.		OTC						-369.778,33	-0,23
GBP/EUR 3,70 Mio.		OTC						-92.169,27	-0,06
CHF/EUR 6,00 Mio.		OTC						-15.146,61	-0,01
JPY/EUR 210,00 Mio.		OTC						7.639,72	0,00
AUD/EUR 0,90 Mio.		OTC						3.913,36	0,00
HKD/EUR 15,00 Mio.		OTC						-16.479,04	-0,01
Summe der Devisen-Derivate							EUR	-482.020,17	-0,30
Bankguthaben									
EUR - Guthaben bei:									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	7.902.433,55				7.902.433,55	4,86
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			CHF	80.719,61				77.723,37	0,05
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			AUD	1.177,90				738,10	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			USD	11.622,63				10.409,88	0,01
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			GBP	5.920,01				7.112,83	0,00
Summe der Bankguthaben							EUR	7.998.417,73	4,92
Sonstige Vermögensgegenstände									
Zinsansprüche			EUR	202.370,77				202.370,77	0,12
Summe sonstige Vermögensgegenstände							EUR	202.370,77	0,12
Sonstige Verbindlichkeiten 1)			EUR	-137.053,60			EUR	-137.053,60	-0,08
Fondsvermögen							EUR	162.651.993,79	100 2)
Aramea Balanced Convertible A									
Anteilwert							EUR	66,95	
Umlaufende Anteile							STK	456.263	
Aramea Balanced Convertible I									
Anteilwert							EUR	54,34	
Umlaufende Anteile							STK	1.190.945	
Aramea Balanced Convertible S									
Anteilwert							EUR	56,15	
Umlaufende Anteile							STK	1.200.000	

Fußnoten:

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

2) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Abwicklung von Transaktionen durch verbundene Unternehmen. Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 99,23 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 250.544.209,51 EUR.

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)		per 31.01.2022	
Australischer Dollar	AUD	1,595850	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	1,038550	= 1 Euro (EUR)
Britisches Pfund	GBP	0,832300	= 1 Euro (EUR)
Hongkong-Dollar	HKD	8,702050	= 1 Euro (EUR)
Japanischer Yen	JPY	128,605000	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,116500	= 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					
0,187500000% Cofinimmo S.A./N.V. EO-Convertible Bonds 2016(21)	DE000DU18209	EUR	-	511	
0,187500000% Cofinimmo S.A./N.V. EO-Convertible Bonds 2016(21)	BE0002259282	STK	3.500	3.500	
0,000000000% Chugoku El. Power Co.Inc., The YN-Zero Conv. Bonds 17/22	XS1720963443	JPY	-	60.000	
0,000000000% Cie Génle Étis Michelin SCpA DL-Exchangeable Bonds 17/22	FR0013230745	USD	-	1.200	
2,500000000% Universe Trek Ltd. DL-Conv. Bonds 2020(23/25)	XS2193653818	USD	-	800	
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
1,500000000% Immofinanz AG EO-Conv. Bonds 2017(24)	XS1551932046	EUR	1.100	2.500	
0,237500000% Symrise AG Senior Nts v.2017(2024) Reg.S	DE000SYM7787	EUR	-	1.800	
4,950000000% Prospect Capital Corp. DL-Conv. Notes 2017(22/22)	US74348TAR32	USD	-	1.300	
0,375000000% VINCI S.A. DL-Exch. Bonds 2017(22)	FR0013237856	USD	-	2.400	
Nicht notierte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
0,000000000% CA Immobilien Anlagen AG Anspr.auf evt. Nachzahl.WSV 17	AT0000A2NW75	EUR	400	400	
Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
Terminkontrakte					
Devisenterminkontrakte (Kauf)					
Kauf von Devisen auf Termin:					
CHF/EUR		EUR			5.093,07
HKD/EUR		EUR			2.368,22
GBP/EUR		EUR			4.362,34
JPY/EUR		EUR			308,16
USD/EUR		EUR			43.208,61
AUD/EUR		EUR			686,04

ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure

EUR 569.447,40

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 %)	95,34
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,30

Sonstige Angaben

Aramea Balanced Convertible A

Anteilwert	EUR	66,95
Umlaufende Anteile	STK	456.263

Aramea Balanced Convertible I

Anteilwert	EUR	54,34
Umlaufende Anteile	STK	1.190.945

Aramea Balanced Convertible S

Anteilwert	EUR	56,15
Umlaufende Anteile	STK	1.200.000

	Aramea Balanced Convertible A	Aramea Balanced Convertible I	Aramea Balanced Convertible S
Währung	EUR	EUR	EUR
Verwaltungsvergütung	1,00%p.a.	0,70%p.a.	0,25%p.a.
Ausgabeaufschlag	3,00%	0,00%	0,00%
Ertragsverwendung	Ausschüttung	Ausschüttung	Ausschüttung
Mindestanlagevolumen	-	EUR 100.000	EUR 20.000.000

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Der Anteilwert wird durch die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH ermittelt. Die Bewertung von Vermögenswerten, die an einer Börse zum Handel zugelassen bzw. in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind, erfolgt zu den handelbaren Schlusskursen des vorhergehenden Börsentages gem. § 27 KARBV. Investmentanteile werden zu den letzten veröffentlichten Rücknahmepreisen angesetzt.

Vermögenswerte, die weder an einer Börse zugelassen noch in einen organisierten Markt einbezogen sind oder für die ein handelbarer Kurs nicht verfügbar ist, werden mit von anerkannten Kursversorgern zur Verfügung gestellten Kursen bewertet. Sollten die ermittelten Kurse nicht belastbar sein, wird auf den mit geeigneten Bewertungsmodellen ermittelten Verkehrswert abgestellt (§ 28 KARBV). Die bezogenen Kurse werden täglich durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft auf Vollständigkeit und Plausibilität geprüft.

Bankguthaben und Festgelder werden mit dem Nominalbetrag und Verbindlichkeiten zum Rückzahlungsbetrag bewertet. Die Bewertung der sonstigen Vermögensgegenstände erfolgt zu ihrem Markt- bzw. Nominalbetrag.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

Die KVG erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütung und Aufwandserstattungen.

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

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

Die KVG gewährt für die Anteilklasse Aramea Balanced Convertible S 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

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT, VERWAHRSTELLE UND GREMIEN

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT:

HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft
mit beschränkter Haftung
Postfach 60 09 45 | 22209 Hamburg
Hausanschrift: Kapstadtring 8 | 22297 Hamburg

Kunden-Servicecenter:
Telefon: (0 40) 3 00 57 - 62 96
Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70
Internet: www.hansainvest.com
E-Mail: service@hansainvest.de

Gezeichnetes Kapital: € 10.500.000,00
Eigenmittel: € 15.743.950,10
(Stand: 31.12.2020)

GESELLSCHAFTER:

SIGNAL IDUNA Allgemeine Versicherung AG, Dortmund
SIGNAL IDUNA Lebensversicherung a.G., Hamburg

VERWAHRSTELLE:

DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital: € 20.500.000,00
Eigenmittel gem. Kapitaladäquanzverordnung (CRR):
€ 277.285.859,14
(Stand: 31.12.2020)

EINZAHLUNGEN:

UniCredit Bank AG, München
(vorm. Bayerische Hypo- und Vereinsbank)
BIC: HYVEDEMM300 | IBAN: DE15200300000000791178

AUFSICHTSRAT:

Martin Berger (Vorsitzender),
Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
(zugleich Vorsitzender des Aufsichtsrates der SIGNAL IDU-
NA Asset Management GmbH)

Dr. Karl-Josef Bierth (stellvertretender Vorsitzender),
Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg

Markus Barth, Vorsitzender des Vorstandes der
Aramea Asset Management AG, Hamburg

Dr. Thomas A. Lange, Vorsitzender des Vorstandes
der National-Bank AG, Essen

Prof. Dr. Harald Stützer, Geschäftsführender Gesellschafter
der STUETZER Real Estate Consulting GmbH, Gerolsbach

Prof. Dr. Stephan Schüller, Kaufmann

WIRTSCHAFTSPRÜFER:

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Hamburg

GESCHÄFTSFÜHRUNG:

Dr. Jörg W. Stotz (Sprecher, zugleich Aufsichtsratsvorsit-
zender der HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied der Ge-
schäftsführung der SIGNAL IDUNA Asset Management
GmbH und der HANSAINVEST Real Assets GmbH sowie
Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Manage-
ment AG)

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

Ludger Wibbeke (zugleich stellvertretender Aufsichtsrats-
vorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. sowie Vorsitzen-
der des Aufsichtsrates der WohnSelect
Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Telefon (040) 3 00 57-62 96
Fax (040) 3 00 57-60 70

service@hansainvest.de
www.hansainvest.com

HANSAINVEST