

# Halbjahresbericht zum 29. Februar 2020

Vermögenspooling Fonds Nr. 1

# Sehr geehrte Anlegerin, sehr geehrter Anleger,

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

Vermögenspooling Fonds Nr. 1

in der Zeit vom 1. September 2019 bis 29. Februar 2020.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von 0,45 %.

Den folgenden Seiten können Sie entnehmen, wie sich die Vermögensaufstellung des Sondervermögens im Detail per Ende Februar 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, Andreas Hausladen, Ludger Wibbeke

Hamburg, im April 2020

## So behalten Sie den **Überblick:**

Vermögensübersicht per 29. Februar 2020 .....	4
Vermögensaufstellung per 29. Februar 2020 .....	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV .....	13
Kapitalverwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle und Gremien .....	15

# Vermögensübersicht per 29. Februar 2020

Fondsvermögen: EUR 25.364.224,52 (23.902.115,47)

Umlaufende Anteile: 2.553.457 (2.369.421)

Vermögensaufteilung in TEUR/%			
	Kurswert in Fonds- währung	% des Fonds- vermögens	% des Fonds- vermögens per 31.08.2019
<b>I. Vermögensgegenstände</b>			
1. Aktien	4.445	17,51	(18,63)
2. Anleihen	16.572	65,32	(63,66)
3. Sonstige Wertpapiere	2.106	8,30	(9,59)
4. Derivate	-18	-0,03	(-0,03)
5. Bankguthaben	2.145	8,44	(7,56)
6. Sonstige Vermögensgegenstände	138	0,55	(0,69)
<b>II. Verbindlichkeiten</b>			
	-24	-0,09	(-0,11)
<b>III. Fondsvermögen</b>			
	<b>25.364</b>	<b>100,00</b>	

# Vermögensaufstellung per 29. Februar 2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>									
<b>Aktien</b>									
adidas	DE-000A1EWWW0		STK	200	200	430	EUR 257,150000	51.430,00	0,20
Allianz	DE0008404005		STK	1.030	0	0	EUR 204,450000	210.583,50	0,83
AXA	FR0000120628		STK	2.550	0	0	EUR 21,855000	55.730,25	0,22
BASF	DE000BASF111		STK	2.440	2.440	1.000	EUR 55,840000	136.249,60	0,54
Beiersdorf	DE0005200000		STK	450	450	0	EUR 96,820000	43.569,00	0,17
Compagnie de Saint-Gobain	FR0000125007		STK	1.400	0	3.000	EUR 33,040000	46.256,00	0,18
Danone	FR0000120644		STK	1.800	0	0	EUR 65,400000	117.720,00	0,46
Deutsche Post	DE0005552004		STK	2.200	0	0	EUR 28,605000	62.931,00	0,25
Deutsche Telekom	DE0005557508		STK	8.800	8.800	6.100	EUR 15,324000	134.851,20	0,53
Deutsche Wohnen	DE000A0HN5C6		STK	1.800	1.800	0	EUR 36,890000	66.402,00	0,26
E.ON SE	DE000ENAG999		STK	6.500	6.500	11.550	EUR 10,852000	70.538,00	0,28
Fresenius Medical Care	DE0005785802		STK	900	0	900	EUR 70,700000	63.630,00	0,25
Hannover Rück SE	DE0008402215		STK	400	0	500	EUR 168,400000	67.360,00	0,27
Heineken N.V.	NL0000009165		STK	600	0	0	EUR 93,300000	55.980,00	0,22
Henkel	DE0006048432		STK	2.690	1.370	600	EUR 86,480000	232.631,20	0,92
Iberdrola	ES0144580Y14		STK	7.180	131	7.051	EUR 10,770000	77.328,60	0,30
Infineon Technologies AG	DE0006231004		STK	3.000	8.000	5.000	EUR 19,512000	58.536,00	0,23
ING Groep	NL0011821202		STK	16.500	12.500	0	EUR 8,831000	145.711,50	0,57
L'Oréal	FR0000120321		STK	530	0	250	EUR 246,600000	130.698,00	0,52
LVMH	FR0000121014		STK	170	170	0	EUR 369,850000	62.874,50	0,25
Merck	DE0006599905		STK	600	0	0	EUR 112,900000	67.740,00	0,27
Münchener Rückversicherung	DE0008430026		STK	860	0	0	EUR 244,600000	210.356,00	0,83
Nordea Bank Abp	FI4000297767		STK	14.800	0	0	EUR 7,321000	108.350,80	0,43
Schneider Electric	FR0000121972		STK	700	0	0	EUR 93,740000	65.618,00	0,26
Unilever N.V. Aandelen op naam EO -,16	NL0000388619		STK	2.500	2.500	0	EUR 49,870000	124.675,00	0,49
WashTec AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0007507501		STK	2.700	2.700	0	EUR 50,900000	137.430,00	0,54
Nestlé	CH0038863350		STK	700	1.300	600	CHF 101,760000	66.837,44	0,26
Roche (Genussscheine)	CH0012032048		STK	700	0	0	CHF 322,450000	211.789,82	0,83
Schindler	CH0024638196		STK	250	250	0	CHF 217,100000	50.926,58	0,20
Experian	GB00B19NLV48		STK	2.100	4.200	2.100	GBP 26,690000	65.684,99	0,26
Reckitt Benckiser Group	GB00B24CGK77		STK	1.700	0	0	GBP 58,410000	116.368,22	0,46
China Mobile	HK0941009539		STK	14.000	14.000	0	HKD 63,400000	103.680,08	0,41
Alibaba Group Holding Ltd. Reg.Shs (sp.ADRs)/1 DL-,000025	US01609W1027		STK	350	350	0	USD 205,030000	65.331,85	0,26
Berkshire Hathaway	US0846707026		STK	1.000	0	0	USD 207,480000	188.892,94	0,74
Blackrock	US09247X1019		STK	150	150	0	USD 475,820000	64.979,06	0,26
Fedex	US31428X1063		STK	1.050	1.050	0	USD 138,760000	132.645,67	0,52

## Vermögensaufstellung zum 29.02.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
Johnson & Johnson	US4781601046		STK	720	720	0	USD 139,120000	91.193,01	0,36
JPMorgan Chase	US46625H1005		STK	800	800	0	USD 121,370000	88.397,67	0,35
Procter & Gamble	US7427181091		STK	1.000	0	0	USD 113,500000	103.332,12	0,41
Union Pacific	US9078181081		STK	400	400	0	USD 159,620000	58.128,19	0,23
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
2,125000000% Aaroundtown SA EO-Notes 2016(16/23)	XS1532877757		EUR	300	0	0	% 106,387000	319.161,00	1,26
1,500000000% ATF Netherlands EO-Notes 16/22	XS1403685636		EUR	200	0	0	% 103,681000	207.362,00	0,82
1,000000000% BMW Finance N.V. EMTN 16/22	XS1363560977		EUR	400	0	0	% 102,363000	409.452,00	1,61
0,750000000% BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2019(26)	XS2010447238		EUR	90	0	0	% 103,451870	93.106,68	0,37
1,125000000% BNP Paribas S.A. EO-Medium-Term Notes 2016(23)	XS1345331299		EUR	300	0	0	% 103,631345	310.894,04	1,23
2,150000000% Booking Holdings Inc. EO-Notes 15/22	XS1325825211		EUR	300	0	0	% 105,545335	316.636,01	1,25
0,750000000% Caisse des Depots et Consign. EO-Medium-Term Notes 2018(28)	FR0013365269		EUR	500	0	0	% 108,262335	541.311,68	2,13
1,750000000% Carrefour EO-MTN 14/22	XS1086835979		EUR	300	0	0	% 103,936500	311.809,50	1,23
0,750000000% Carrefour S.A. EO-Med.-Term Notes 2016(16/24)	XS1401331753		EUR	200	0	0	% 102,386500	204.773,00	0,81
4,000000000% Coty Inc. EO-Notes 2018(18/23) Reg.S	XS1801786275		EUR	119	0	0	% 101,000000	120.190,00	0,47
5,125000000% Deutsche Lufthansa AG FLR-Sub. Anl.v.2015(2021/2075)	XS1271836600		EUR	200	0	0	% 103,625000	207.250,00	0,82
3,500000000% DIC Asset AG Inh.-Schuldv v.2018(2021/2023)	DE000A2NBZG9		EUR	150	0	0	% 105,850000	158.775,00	0,63
3,625000000% EnBW Energie Baden-Württem. FLR-Anl. 14/76	XS1044811591		EUR	200	0	0	% 103,541670	207.083,34	0,82
0,125000000% European Investment Bank EO-MTN 19/29	XS2015227494		EUR	500	500	0	% 104,128755	520.643,78	2,05
1,000000000% Evonik Industries AG MTN v.15(22/23)	XS1170787797		EUR	300	0	0	% 102,974500	308.923,50	1,22
1,375000000% Galp Gás Natural Distrib. S.A. EO-MTN 16/23	PTGGDA0E0001		EUR	100	0	0	% 104,341000	104.341,00	0,41
2,875000000% Infineon Technologies AG Anleihe v.2019(2025)/und	XS2056730323		EUR	200	200	0	% 101,350000	202.700,00	0,80
6,000000000% Instituto de Credito Oficial EO-Medium-Term Notes 2012(27)	XS0804086410		EUR	250	0	0	% 142,028141	355.070,35	1,40
4,500000000% Italien EO-BTP 13/23	IT0004898034		EUR	160	0	0	% 113,715185	181.944,30	0,72
6,440000000% Landesbank Baden-Württemberg EO-Nachr.MTN IHS.Ser.189 00/30	XS0113734379		EUR	120	0	0	% 151,449402	181.739,28	0,72
0,125000000% Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN OPF S. H343 v.2020(30)	XS2106579670		EUR	500	500	0	% 102,711500	513.557,50	2,02
1,375000000% Merck Financial Services GmbH Med.-Term Nts. 15/22	XS1284570626		EUR	200	0	0	% 103,479095	206.958,19	0,82
3,375000000% Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2014(2024/2074)	XS1152343668		EUR	200	0	0	% 111,750000	223.500,00	0,88
1,375000000% METRO Wholesale & Food Spec. MTN 14/21	DE000A13R8M3		EUR	100	0	100	% 102,120000	102.120,00	0,40
1,625000000% Mondelez International Inc. EO-Notes 2016(16/23)	XS1346872580		EUR	100	0	0	% 104,547500	104.547,50	0,41
0,500000000% Niederlande EO-Anl. 16/26	NL0011819040		EUR	550	0	0	% 107,009500	588.552,25	2,32
0,500000000% NRW.BANK MTN-IHS Ausg. OAE v.17(27)	DE000NWBOAE6		EUR	500	0	0	% 106,089000	530.445,00	2,09
5,000000000% Orange S.A. EO-FLR MTN 14(26/Und.)	XS1115498260		EUR	200	0	0	% 122,039000	244.078,00	0,96
4,000000000% Orange S.A. EO-FLR MTN14(21/Und.)	XS1115490523		EUR	300	0	0	% 105,812815	317.438,45	1,25
2,625000000% Orsted EO-MTN 12/22	XS0829114999		EUR	200	0	0	% 107,176500	214.353,00	0,85
5,650000000% Portugal 13/24	PTOTEQOE0015		EUR	500	0	0	% 123,249000	616.245,00	2,43
2,250000000% RCI Banque EO-MTN 14/21	XS1048519596		EUR	300	0	0	% 102,468500	307.405,50	1,21
1,625000000% Solvay S.A. EO-Notes 2015(15/22)	BE6282459609		EUR	300	0	0	% 104,272500	312.817,50	1,23

## Vermögensaufstellung zum 29.02.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
1,600000000% Spanien EO-Bonos 15/25	ES00000126Z1		EUR	500	0	0	% 108,906000	544.530,00	2,15
0,600000000% Spanien EO-Bonos 19/29	ES0000012F43		EUR	200	200	0	% 103,231000	206.462,00	0,81
2,350000000% Spanien EO-Obligaciones 2017(33)	ES00000128Q6		EUR	400	400	0	% 123,706500	494.826,00	1,95
2,250000000% Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. EO-Notes 2018(18/26) Reg.S	XS1843449122		EUR	115	0	0	% 113,221800	130.205,07	0,51
3,987000000% Telefonica EO-MTN 13/23	XS0874864860		EUR	300	0	0	% 112,022935	336.068,81	1,32
2,625000000% Telenor EO-MTN 12/24	XS0862442331		EUR	200	0	0	% 112,751000	225.502,00	0,89
0,875000000% TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/30)	XS2002491780		EUR	200	0	0	% 106,091000	212.182,00	0,84
0,875000000% Verizon Communications Inc. EO-Notes 2016(16/25)	XS1405766897		EUR	300	0	0	% 104,190000	312.570,00	1,23
3,100000000% Vodafone Group PLC EO-FLR Notes 2018(23/79)	XS1888179477		EUR	200	0	0	% 104,424500	208.849,00	0,82
7,000000000% International Finance Corp. MN-Medium-Term Notes 2017(27)	XS1649504096		MXN	3.800	3.800	0	% 100,677500	179.297,62	0,71
3,750000000% Norwegen, Königreich NK-Anl. 10/21	N00010572878		NOK	1.500	0	0	% 102,955000	149.556,94	0,59
4,450000000% AT & T Inc. DL-Notes 2011(11/21)	US00206RAX08		USD	100	0	0	% 103,422000	94.156,96	0,37
2,800000000% BMW US Capital LLC DL-Notes 2016(16/26) Reg.S	USU09513GM51		USD	150	0	0	% 104,393500	142.562,14	0,56
2,125000000% European Investment Bank DL-Notes 2014(21)	US298785GP55		USD	300	0	0	% 101,179500	276.346,05	1,09
3,000000000% Microsoft Corp. DL-Notes 2010(20)	US594918AH79		USD	200	0	0	% 100,836000	183.605,24	0,72
5,462000000% Telefonica Emisiones S.A.U. DL-Notes 2011(21)	US87938WAP86		USD	300	0	0	% 103,425000	282.479,06	1,11
2,450000000% United Parcel Service Inc. DL-Notes 2012(12/22)	US911312AQ92		USD	100	0	0	% 102,448500	93.270,67	0,37
2,950000000% Vodafone Group PLC DL-Notes 2013(13/23)	US92857WBC38		USD	200	0	0	% 103,711500	188.841,04	0,74
<b>Summe der börsengehandelten Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>17.819.862,74</b>	<b>70,24</b>
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>									
<b>Aktien</b>									
Cisco Systems	US17275R1023		STK	1.700	0	0	USD 40,040000	61.970,14	0,24
eBay	US2786421030		STK	3.900	3.900	0	USD 35,040000	124.413,69	0,49
Expedia Inc. Registered Shares DL-,0001	US30212P3038		STK	710	710	0	USD 98,710000	63.805,63	0,25
Facebook Inc.	US30303M1027		STK	300	300	0	USD 189,750000	51.825,38	0,20
Microsoft Corp.	US5949181045		STK	900	500	400	USD 158,180000	129.608,52	0,51
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
0,625000000% Berlin, Land Landessch.v.2016(2026) Ausg.487	DE000A168015		EUR	400	0	0	% 106,198055	424.792,22	1,67
2,125000000% Portugal, Republik EO-Obr. 2018/28	PT0TEVOE0018		EUR	600	0	0	% 116,443000	698.658,00	2,75
1,125000000% Sixt SE Anleihe v.2016(2022/2022)	DE000A2BPDU2		EUR	200	0	0	% 102,309500	204.619,00	0,81
3,800000000% Amazon.com Inc. DL-Notes 14/24	US023135AN60		USD	250	0	0	% 109,880000	250.091,04	0,99
5,179000000% Banco Santander S.A. DL-Notes 15/25	US05971KAA79		USD	200	0	0	% 114,086500	207.732,16	0,82
2,625000000% Diageo Capital PLC DL-Notes 2013(13/23)	US25243YAU38		USD	140	140	0	% 103,355000	131.734,34	0,52
3,800000000% eBay Inc. DL-Notes 2016(16/22)	US278642AN33		USD	150	0	0	% 103,886000	141.869,08	0,56
2,600000000% Goldman Sachs Group DL-Nts 15/20	US38148LAA44		USD	24	0	0	% 100,063000	21.863,73	0,09
2,875000000% Intl Business Machines Corp. DL-Notes 2015(15/22)	US459200JC60		USD	200	0	0	% 103,448000	188.361,25	0,74
<b>Summe der an organisierten Märkten zugelassenen oder in diese einbezogenen Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>2.701.344,18</b>	<b>10,64</b>

## Vermögensaufstellung zum 29.02.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2020	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
					im Berichtszeitraum				
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>									
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>									
0,800000000% AT & T Inc. EO-Notes 2019(19/30)	XS2051362072		EUR	190	190	0	% 99,449000	188.953,10	0,74
0,277000000% Bank of China (Luxembourg) SA EO-FLR Med.-Term Nts 2017(20)	XS1599275630		EUR	100	0	0	% 100,036500	100.036,50	0,39
0,875000000% Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 2018(23)	XS1881574591		EUR	200	0	0	% 103,303615	206.607,23	0,81
<b>Summe der nicht notierten Wertpapiere</b>							<b>EUR</b>	<b>495.596,83</b>	<b>1,94</b>
<b>Investmentanteile</b>									
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>									
DJE-Equity Market Neutral EU Inhaber-Anteile XP (EUR) o.N.	LU1681425523		ANT	1.000	0	0	EUR 92,060000	92.060,00	0,36
FISCH Convert.Gbl Sustainable Namens-Anteile BE2 o.N.	LU1253562653		ANT	8.500	0	0	EUR 111,710000	949.535,00	3,74
iShares DJ Euroz.Sust.Scr.U.ETF DE	DE000A0F5UG3		ANT	13.000	10.000	12.000	EUR 12,858000	167.154,00	0,66
iShs II-JPM.\$ Em.Mkt.Bd UC.ETF Registered Shares o.N.	IE00B2NPKV68		ANT	2.440	0	0	EUR 103,790000	253.247,60	1,00
iShsII-DJ Gl.Sustain.Scr.U.ETF Registered Shs USD (Acc) o.N.	IE00B57X3V84		ANT	7.000	0	3.000	EUR 38,275000	267.925,00	1,06
UBS ETF-U.E.-MSCI USA S.R.U.E. Namens-Ant.(USD) A-dis o.N.	LU0629460089		ANT	2.000	0	0	EUR 114,540000	229.080,00	0,90
UBS-ETF-U.E.MSCI E.Mkt.Soc.Re. Inhaber-Anteile A Dis. USD o.N.	LU1048313891		ANT	13.000	0	12.000	EUR 11,310000	147.030,00	0,59
<b>Summe der Investmentanteile</b>							<b>EUR</b>	<b>2.106.031,60</b>	<b>8,31</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>23.122.835,35</b>	<b>91,13</b>
<b>Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)</b>									
<b>Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten</b>									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>									
DAX Futures 20.03.2020		XEUR	EUR	Anzahl -3				6.625,00	0,03
ESTX 50 Index Futures 20.03.2020		XEUR	EUR	Anzahl -11				1.210,00	0,00
E-Mini S&P 500 Index Futures 20.03.2020		XCME	USD	Anzahl -4				19.983,61	0,08
<b>Optionsrechte</b>									
<b>Optionsrechte auf Aktienindices</b>									
Call DAX 13500,000000000 20.03.2020		XEUR		Anzahl -2			EUR	-113,00	0,00
Call DAX 15000,000000000 18.12.2020		XEUR		Anzahl -2			EUR	-545,00	0,00
Call S&P 500 Index Options 3300,000000000 20.03.2020		XCBO		Anzahl -1			USD	-209,40	0,00
Call FGBL 03/20 172,500000000 27.03.2020		XEUR		Anzahl -3			EUR	-3.450,00	0,02
<b>Summe der Aktienindex-Derivate</b>							<b>EUR</b>	<b>23.501,21</b>	<b>0,13</b>
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>									
<b>Offene Positionen</b>									
USD/EUR 1,30 Mio.		OTC						-22.889,14	-0,09
GBP/EUR 0,15 Mio.		OTC						768,52	0,00
<b>Geschlossene Positionen</b>									
USD/EUR 0,60 Mio.		OTC						-19.552,43	-0,08
<b>Summe der Terminkontrakte</b>							<b>EUR</b>	<b>-41.673,05</b>	<b>-0,16</b>



## Vermögensaufstellung zum 29.02.2020

Gattungsbezeichnung	ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 29.02.2020	Käufe/ Zugänge	Ver- käufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermö- gens
					im Berichtszeitraum				
<b>Bankguthaben</b>									
<b>EUR - Guthaben bei:</b>									
Bank: Hamburger Volksbank			EUR	931,71				931,71	0,00
Bank: UniCredit Bank AG			EUR	0,06				0,06	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	1.201.236,18				1.201.236,18	4,73
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen:</b>									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			NOK	891,46				86,33	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			DKK	5.064,68				677,78	0,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen:</b>									
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			CHF	114.697,30				107.621,21	0,42
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			HKD	100,31				11,72	0,00
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			AUD	22.116,18				13.240,45	0,05
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			NZD	29.402,34				16.908,10	0,07
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			USD	804.045,11				732.014,85	2,88
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			MXN	27.210,02				1.275,23	0,01
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			JPY	428.901,00				3.549,33	0,01
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			GBP	57.563,04				67.459,32	0,27
<b>Summe der Bankguthaben</b>							<b>EUR</b>	<b>2.145.012,27</b>	<b>8,44</b>
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Zinsansprüche			EUR	135.754,76				135.754,76	0,54
Dividendenansprüche			EUR	2.521,18				2.521,18	0,01
<b>Summe sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>138.275,94</b>	<b>0,55</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten 1)</b>			<b>EUR</b>	<b>-23.727,20</b>			<b>EUR</b>	<b>-23.727,20</b>	<b>-0,09</b>
<b>Fondsvermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>25.364.224,52</b>	<b>100 2)</b>
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>9,933</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>2.553.457</b>	

### Fußnoten:

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

2) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen 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 71,31 %. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 20.476.538,18 EUR.

## Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Devisenkurse (in Mengennote)		per 28.02.2020	
Australischer Dollar	AUD	1,670350	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	1,065750	= 1 Euro (EUR)
Dänische Krone	DKK	7,472500	= 1 Euro (EUR)
Britisches Pfund	GBP	0,853300	= 1 Euro (EUR)
Hongkong-Dollar	HKD	8,560950	= 1 Euro (EUR)
Japanischer Yen	JPY	120,840000	= 1 Euro (EUR)
Mexikanischer Peso	MXN	21,337400	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	NOK	10,326000	= 1 Euro (EUR)
Neuseeland-Dollar	NZD	1,738950	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,098400	= 1 Euro (EUR)

### Marktschlüssel

#### b) Terminbörsen

XCBO CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE

XEUR EUREX DEUTSCHLAND

XCME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE

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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
UBS Group	CH0244767585	STK	-	8.800	
Vestas Wind Systems	DK0010268606	STK	-	1.200	
Covestro AG Inhaber-Aktien o.N.	DE0006062144	STK	1.200	1.200	
Daimler	DE0007100000	STK	1.600	1.600	
Krones	DE0006335003	STK	-	500	
Nokia	FI0009000681	STK	26.500	26.500	
Orange	FR0000133308	STK	-	3.000	
SAP	DE0007164600	STK	-	550	
TeamViewer AG Inhaber-Aktien o.N.	DE000A2YN900	STK	3.900	3.900	
Telefónica	ES0178430E18	STK	-	5.000	
Total S.A.	FR0000120271	STK	-	2.300	
Rio Tinto	GB0007188757	STK	-	1.900	
3M Co.	US88579Y1010	STK	500	1.400	
Colgate-Palmolive	US1941621039	STK	-	1.500	
Merck & Co.	US58933Y1055	STK	-	1.300	
Pfizer	US7170811035	STK	-	3.900	
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
4,250000000% NGG Fin. EO-FLR Notes 13/76	XS0903531795	EUR	-	300	
0,400000000% Spanien EO-Obligaciones 17/22	ES0000012801	EUR	-	500	
<b>Andere Wertpapiere</b>					
Iberdrola Anrechte	ES06445809J6	STK	7.050	7.050	
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
Novo-Nordisk	DK0060534915	STK	-	1.300	
Alphabet Inc. Reg.Sh. Capi Stk Class C o.N.	US02079K1079	STK	110	110	
Amazon.com	US0231351067	STK	-	55	
Intel Corp.	US4581401001	STK	-	1.200	
PayPal Holdings	US70450Y1038	STK	-	2.300	
<b>Aktien</b>					
Iberdrola S.A. Acciones Port. Em.1/20 EO -,75	ES0144583210	STK	131	131	
innogy SE z.Verkauf eing.Inhaber-Aktien	DE000A2LQ2L3	STK	-	3.000	
<b>Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)</b>					
<b>Terminkontrakte</b>					
<b>Zinsterminkontrakte</b>					
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswert: Bundesrep.Deutschland Euro-BUND synth. Anleihe		EUR			2.940,98
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>					
Verkaufte Kontrakte:					
Basiswerte: DAX Index, ESTX 50 Index (Price) (EUR)		EUR			4.690,23
Basiswert: S&P 500 Index		USD			404,37

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>					
Verkauf von Devisen auf Termin:					
GBP/EUR		EUR			343,29
<b>Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate</b>					
<b>Optionsrechte auf Aktienindices:</b>					
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put):					
Basiswert: DAX Index		EUR			2,83
Basiswert: S&P 500 Index		USD			11,45
Verkaufte Kaufoptionen (Call):					
Basiswert: DAX Index		EUR			1,84
Basiswert: S&P 500 Index		USD			14,82

# Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

## Angaben nach der Derivateverordnung

**Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR 2.244.942,59

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 %)	91,13
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,03

## Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	9,933
Umlaufende Anteile	STK	2.553.457

## Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

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

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

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

## An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen

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

DJE-Equity Market Neutral EU Inhaber-Anteile XP (EUR) o.N.	0,3000 %
FISCH Convert.Gbl Sustainable Namens-Anteile BE2 o.N.	0,5000 %
iShares DJ Euroz.Sust.Scr.U.ETF DE	0,4000 %
iShs II-JPM.\$ Em.Mkt.Bd UC.ETF Registered Shares o.N.	0,4500 %
iShsII-DJ Gl.Sustain.Scr.U.ETF Registered Shs USD (Acc) o.N.	0,6000 %
UBS ETF-U.E.-MSCI USA S.R.U.E. Namens-Ant.(USD) A-dis o.N.	0,3300 %
UBS-ETF-U.E.MSCI E.Mkt.Soc.Re. Inhaber-Anteile A Dis.USD o.N.	0,5300 %

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.com](http://www.hansainvest.com)  
E-Mail: [service@hansainvest.de](mailto:service@hansainvest.de)

Gezeichnetes Kapital:  
€ 10.500.000,00  
Eigenmittel:  
€ 21.729.099,42  
(Stand: 31.12.2018)

## 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):  
€ 222.136.245,61  
(Stand: 31.12.2018)

## 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

Thomas Gollub,  
Berater der Aramea Asset  
Management AG, Wedel

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 Aufsichtsratsvorsitzender der  
HANSAINVEST LUX S.A., Mitglied der  
Geschäftsführung der SIGNAL IDUNA  
Asset Management GmbH sowie der  
HANSAINVEST Real Assets GmbH)

Nicholas Brinckmann  
(zugleich Sprecher der Geschäftsführung  
HANSAINVEST Real Assets GmbH)

Andreas Hausladen (ab 01.04.2020)

Ludger Wibbeke  
(stellvertretender Aufsichtsratsvor-  
sitzender der HANSAINVEST LUX S.A.)

**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](mailto:service@hansainvest.de)  
[www.hansainvest.de](http://www.hansainvest.de)