

HANSAINVEST – SERVICE-KVG

HALBJAHRESBERICHT

VAB Strategie BASIS

31. März 2024

Inhaltsverzeichnis

Vermögensübersicht per 31.03.2024	4
Vermögensaufstellung per 31.03.2024	5
Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV	9
Allgemeine Angaben	11

Einleitende Worte

Sehr geehrte Anlegerin,

sehr geehrter Anleger,

der vorliegende Halbjahresbericht informiert Sie über die Entwicklung des offenen inländischen Publikums-AIF (Sonstiges Sondervermögen)

VAB Strategie BASIS

in der Zeit vom 01.10.2023 bis 31.03.2024.

In diesem Zeitraum erzielte der Fonds eine Wertentwicklung von + 10,43 %.

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

Vermögensübersicht per 31.03.2024

VERMÖGENSÜBERSICHT

	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens ¹⁾
I. Vermögensgegenstände	9.323.890,64	100,29
1. Aktien	3.041.572,33	32,71
2. Anleihen	1.856.827,32	19,97
3. Zertifikate	1.779.287,18	19,14
4. Investmentanteile	2.302.839,75	24,77
5. Derivate	74.769,74	0,80
6. Bankguthaben	254.830,59	2,74
7. Sonstige Vermögensgegenstände	13.763,73	0,15
II. Verbindlichkeiten	-26.587,16	-0,29
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-26.587,16	-0,29
III. Fondsvermögen	EUR 9.297.303,48	100,00

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

Vermögensaufstellung per 31.03.2024

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.03.2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
							im Berichtszeitraum			
Börsengehandelte Wertpapiere								EUR	5.779.858,83	62,17
Aktien								EUR	3.041.572,33	32,71
CH0009002962	Barry Callebaut		STK	80	0	0	CHF	1.288,0000	105.148,22	1,13
CH0038863350	Nestlé S.A.		STK	2.674	0	0	CHF	96,0000	261.956,22	2,82
CH0012005267	Novartis AG		STK	1.909	0	0	CHF	86,6600	168.818,76	1,82
CH1243598427	Sandoz Group AG Namens-Aktien SF -,05		STK	381	382	1	CHF	26,6000	10.341,96	0,11
FR000120644	Danone S.A.		STK	3.000	0	0	EUR	59,7300	179.190,00	1,93
DE0008430026	Münchener Rückversicherung AG		STK	500	0	0	EUR	450,3000	225.150,00	2,42
DE0007164600	SAP SE		STK	1.000	0	0	EUR	182,0400	182.040,00	1,96
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	15.813	0	0	EUR	27,2500	430.904,25	4,63
DE000ZAL1111	Zalando SE Inhaber-Aktien o.N.		STK	1.000	0	0	EUR	26,4600	26.460,00	0,28
US02079K3059	Alphabet Inc. Cl. A		STK	1.600	0	0	USD	150,8700	223.077,35	2,40
US0231351067	Amazon.com Inc.		STK	2.000	0	0	USD	179,8300	332.372,24	3,57
US1890541097	Clorox		STK	1.000	0	0	USD	152,7400	141.151,46	1,52
US1912161007	Coca-Cola Co., The		STK	2.500	0	0	USD	61,0300	140.998,98	1,52
US1941621039	Colgate-Palmolive		STK	2.000	0	0	USD	89,9500	166.250,81	1,79
US4878361082	Kellanova Co.		STK	300	0	0	USD	56,6500	15.705,57	0,17
US49271V1008	Keurig Dr Pepper Inc. Registered Shares DL -,01		STK	4.700	0	0	USD	30,5900	132.864,80	1,43
US5949181045	Microsoft Corp.		STK	600	0	0	USD	421,4300	233.673,41	2,51
US7134481081	PepsiCo Inc		STK	400	0	0	USD	173,5700	64.160,43	0,69
US92942W1071	W.K. Kellogg Co. Registered Shares DL -,0001		STK	75	75	0	USD	18,8700	1.307,87	0,01
Verzinsliche Wertpapiere								EUR	1.856.827,32	19,97
DE0001102481	0.0000% Bundesrep.Deutschland Anl.v. 2019 (2050)		EUR	510	0	0	%	53,3930	272.304,30	2,93
AT0000A2EJ08	0.7500% Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 2020(51)		EUR	270	0	0	%	59,3191	160.161,44	1,72
US912810SR05	1.1250% United States of America DL-Bonds 2020(40)		USD	250	0	0	%	62,4375	144.250,76	1,55
US91282CDJ71	1.3750% United States of America DL-Bonds 2021(31)		USD	50	0	0	%	81,7656	37.780,99	0,41
BE0000338476	1.6000% Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 2016(47) Ser. 78		EUR	270	0	0	%	73,2501	197.775,25	2,13
US912810SJ88	2.2500% United States of America DL-Notes 19/49		USD	400	0	0	%	66,5547	246.020,47	2,65
US912810SK51	2.3750% United States of America DL-Notes 2019(49)		USD	400	0	0	%	68,3438	252.633,77	2,72
US912810RC45	3.6250% United States of America DL-Notes 2013(43)		USD	360	0	0	%	88,8984	295.753,05	3,18
US912810FT08	4.5000% US Treasury 06/36		USD	260	0	0	%	104,1094	250.147,29	2,69
Zertifikate								EUR	881.459,18	9,48
DE000A0S9GB0	Xetra-Gold		STK	13.538	0	1.000	EUR	65,1100	881.459,18	9,48

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.03.2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							EUR	897.828,00	9,66
Zertifikate							EUR	897.828,00	9,66
DE000EWGOLD1	Boerse Stuttgart Securities Gold IHS 12/Open End	STK		13.800	0	0	EUR 65,0600	897.828,00	9,66
Investmentanteile							EUR	2.302.839,75	24,77
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	2.302.839,75	24,77
DE000ETFL151	Deka iB.EO L.Sov.D.7-10 U.ETF Inhaber-Anteile	ANT		3.314	0	0	EUR 110,9700	367.754,58	3,96
LU0306115196	Dual Return-Vision Microfinan. Actions au Porteur I-EUR o.N.	ANT		3.479	0	0	EUR 155,4100	540.671,39	5,82
DE000A0D8Q31	iSh. eb.r.Governm. Ger.10.5+	ANT		691	0	0	EUR 130,5400	90.203,14	0,97
IE00BZCQB185	iShs IV-iShs MSCI India UC.ETF	ANT		32.000	0	25.000	EUR 8,3490	267.168,00	2,87
IE00BD8PGZ49	iShsIV-DL Treas.Bd 20+yr U.ETF Reg.Shares EUR Hdgd (Dist)oN	ANT		71.000	0	0	EUR 3,2379	229.890,90	2,47
LU1545768357	RV Bond Select Inhaber-Anteile o.N.	ANT		4.298	0	0	EUR 78,8200	338.768,36	3,64
LU0952581584	Xtrackers II Japan Gov.Bond Inhaber-Anteile 1C o.N.	ANT		27.957	0	0	EUR 7,8672	219.943,31	2,37
IE00BKM4GZ66	iShs-Co.MSCI Em.Mar.IMI UC.ETF Registered Shares o.N.	ANT		8.300	0	0	USD 32,3900	248.440,07	2,67
Summe Wertpapiervermögen							EUR	8.980.526,58	96,59
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)							EUR	74.769,74	0,80
Derivate auf einzelne Wertpapiere							EUR	47.970,00	0,52
Wertpapier-Optionsrechte (Forderungen/Verbindlichkeiten)							EUR	47.970,00	0,52
Optionsrechte auf Aktien							EUR	47.970,00	0,52
Call LVMH 880,0000000000 19.12.2025		XEUR	STK	500			EUR 95,9400	47.970,00	0,52
Aktienindex-Derivate (Forderungen/Verbindlichkeiten)							EUR	26.799,74	0,29
Optionsrechte							EUR	26.799,74	0,29
Optionsrechte auf Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	26.799,74	0,29
Put Mini S+P 500 Index Options on Futures 5150,0000000000 20.09.2024		XCME	Anzahl	5			USD 116,0000	26.799,74	0,29
Bankguthaben							EUR	254.830,59	2,74
EUR - Guthaben bei:							EUR	120.852,22	1,30
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			EUR	120.852,22				120.852,22	1,30
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	133.978,37	1,44
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			CHF	5.303,96				5.412,48	0,06
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			HKD	9.746,39				1.151,23	0,01
Verwahrstelle: Donner & Reuschel AG			USD	137.875,40				127.414,66	1,37
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	13.763,73	0,15
Dividendenansprüche			EUR	1.765,36				1.765,36	0,02

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.03.2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens ¹⁾
	Zinsansprüche		EUR	11.998,37				11.998,37	0,13
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-26.587,16	-0,29
	Sonstige Verbindlichkeiten ²⁾		EUR	-26.587,16				-26.587,16	-0,29
Fondsvermögen							EUR	9.297.303,48	100,00
Anteilwert VAB Strategie BASIS							EUR	38,58	
Umlaufende Anteile VAB Strategie BASIS							STK	240.983,000	

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

²⁾ noch nicht abgeführte Prüfungskosten, Veröffentlichungskosten, Verwahrstellenvergütung, Verwaltungsvergütung

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 28.03.2024					
Hongkong-Dollar	(HKD)	8,466050	=		1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	(CHF)	0,979950	=		1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,082100	=		1 Euro (EUR)

MARKTSCHLÜSSEL

Terminbörse

XCME	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
XEUR	EUREX DEUTSCHLAND

WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG ERSCHEINEN:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
DE000ETFL219	Deka Dt.B.EUROG.Ger.10+ U.ETF	ANT	0	1.962

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
Fehlanzeige				

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 96,59

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 0,81

ZUSÄTZLICHE ANHANGANGABEN GEMÄSS DER VERORDNUNG (EU) 2015/2365 BETREFFEND WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Während des Berichtszeitraums wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

SONSTIGE ANGABEN

Anteilwert VAB Strategie BASIS	EUR	38,58
Umlaufende Anteile VAB Strategie BASIS	STK	240.983,000

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 Aufwandsersatzungen.

Die KVG gewährt sogenannte Vermittlungsfolgeprovision an Vermittler in wesentlichem Umfang aus der von dem Sondervermögen an sie geleisteten Vergütung.

VERWALTUNGSVERGÜTUNGSSATZ FÜR IM SONDERVERMÖGEN GEHALTENE INVESTMENTANTEILE

ISIN	Fondsname	Nominale Verwaltungsvergütung der Zielfonds in %
DE000ETFL219	Deka Dt.B.EUROG.Ger.10+ U.ETF ¹⁾	0,15
DE000ETFL151	Deka iB.EO L.Sov.D.7-10 U.ETF Inhaber-Anteile ¹⁾	0,15
LU0306115196	Dual Return-Vision Microfinan. Actions au Porteur I-EUR o.N. ¹⁾	0,18
DE000A0D8Q31	iSh. eb.r.Governm. Ger.10.5+ ¹⁾	0,16
IE00BZCQB185	iShs IV-iShs MSCI India UC.ETF ¹⁾	0,65
IE00BKM4GZ66	iShs-Co.MSCI Em.Mar.IMI UC.ETF Registered Shares o.N. ¹⁾	0,18
IE00BD8PGZ49	iShsIV-DL Treas.Bd 20+yr U.ETF Reg.Shares EUR Hdgd (Dist)oN ¹⁾	0,10
LU1545768357	RV Bond Select Inhaber-Anteile o.N. ¹⁾	1,20
LU0952581584	Xtrackers II Japan Gov.Bond Inhaber-Anteile 1C o.N. ¹⁾	0,05

¹⁾ Ausgabebefschlüsse oder Rücknahmeabschlüsse wurden nicht berechnet.

BESCHREIBUNG, WIE DIE VERGÜTUNGEN UND GGF. SONSTIGE ZUWENDUNGEN BERECHNET WURDEN

Die HANSAINVEST Hanseatische Investment-GmbH unterliegt den für Kapitalverwaltungsgesellschaften geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben im Hinblick auf die Gestaltung ihres Vergütungssystems. Die Ausgestaltung des Vergütungssystems hat die Gesellschaft in einer internen Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis geregelt. Ziel ist es, ein Vergütungssystem sicherzustellen, das Fehlanreize zur Eingehung übermäßiger Risiken verhindert. Das Vergütungssystem der HANSAINVEST wird unter Einbeziehung des Risikomanagements und der Compliance Beauftragten mindestens jährlich auf seine Angemessenheit und die Einhaltung der rechtlichen Vorgaben überprüft. Eine Erörterung des Vergütungssystems mit dem Aufsichtsrat findet ebenfalls jährlich statt.

Die Vergütung der Mitarbeiter richtet sich grundsätzlich nach dem Manteltarifvertrag für das Versicherungswesen. Je nach Tätigkeit und Verantwortung erfolgt die Vergütung gemäß der entsprechenden Tarifgruppe. Die Ausgestaltung und Vergütungshöhen der Tarifgruppen werden zwischen Arbeitgeber- und Arbeitnehmerverbänden bzw. der Konzernmutter und den Betriebsräten verhandelt, die HANSAINVEST hat hierauf keinen Einfluss. Nur mit wenigen Mitarbeitern inkl. der leitenden Angestellten sind finanzielle Anreizsysteme für variable Vergütungen und Tantiemen vereinbart. Der Anteil der variablen Vergütung darf dabei maximal 30% der Gesamtvergütung ausmachen. Ein Anreiz, ein unverhältnismäßig großes Risiko für die Gesellschaft einzugehen, resultiert aus der variablen Vergütung nicht.

Die Vergütung für die Geschäftsführer der HANSAINVEST erfolgt auf einzelvertraglicher Basis. Sie setzt sich zusammen aus einer monatlichen festen Vergütung und einer jährlichen Tantieme. Die Höhe der Tantieme wird im gesamten Aufsichtsrat erörtert und festgelegt und orientiert sich nicht am Erfolg der einzelnen Fonds.

Derzeit sind nur die Geschäftsführung als Risikoträger der Gesellschaft eingestuft. Die Gesellschaft überprüft die Vergütungssysteme jährlich. Die Vergütungspolitik der HANSAINVEST erfüllt die Anforderungen des § 37 KAGB, als auch die Leitlinien für solide Vergütungspolitiken unter Berücksichtigung der AIFMD (ESMA/2013/232).

ERGEBNISSE DER JÄHRLICHEN ÜBERPRÜFUNG DER VERGÜTUNGSPOLITIK

Im Rahmen der internen jährlichen Überprüfung der Einhaltung der Vergütungspolitik ergaben sich keine Anhaltspunkte dafür, dass die Ausgestaltung von fixen und / oder variablen Vergütungen sich nicht an den Regelungen der Richtlinie über die Vergütungspolitik und Vergütungspraxis orientieren.

ANGABEN ZU WESENTLICHEN ÄNDERUNGEN DER FESTGELEGTEN VERGÜTUNGSPOLITIK

Keine Änderung im Berichtszeitraum

Allgemeine Angaben

KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT

HANSAINVEST Hanseatische Investment-Gesellschaft
mit beschränkter Haftung

Postfach 60 09 45

22209 Hamburg

Hausanschrift:

Kapstadtring 8

22297 Hamburg

Sitz: Hamburg

Telefon: (0 40) 3 00 57 - 62 96

Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70

E-Mail: info@hansainvest.de

Web: www.hansainvest.de

Haftendes Eigenkapital: 28,189 Mio. EUR

Eingezahltes Eigenkapital: 10,500 Mio. EUR

Stand: 31.12.2022

GESELLSCHAFTER

SIGNAL IDUNA Allgemeine Versicherung AG,

Dortmund

SIGNAL IDUNA Lebensversicherung a.G., Hamburg

AUFSICHTSRAT

- Martin Berger
 - Vorsitzender
 - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg (zugleich Vorsitzender des Aufsichtsrates der SIGNAL IDUNA Asset Management GmbH)
- Dr. Karl-Josef Bierth (bis zum 07.11.2023)
 - stellvertretender Vorsitzender
 - Vorstandsmitglied der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
- Dr. Stefan Lemke (ab dem 15.02.2024)
 - stellvertretender Vorsitzender
 - stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrates der DONNER & REUSCHEL AG, Hamburg, Mitglied des Vorstandes der SIGNAL IDUNA Gruppe, Hamburg
- Markus Barth

- Vorsitzender des Vorstandes der Aramea Asset Management AG, Hamburg
- Dr. Thomas A. Lange
 - Vorsitzender des Vorstandes der National-Bank AG, Essen
- Prof. Dr. Harald Stützer
 - Geschäftsführender Gesellschafter der STUETZER Real Estate Consulting GmbH, Gerolsbach
- Prof. Dr. Stephan Schüller
 - Kaufmann

GESCHÄFTSFÜHRUNG

- Dr. Jörg W. Stotz
 - (Sprecher, zugleich Mitglied der Geschäftsführung der HANSAINVEST Real Assets GmbH sowie Mitglied des Aufsichtsrates der Aramea Asset Management AG und der Greiff capital management AG)
- Claudia Pauls (ab dem 01.04.2024)
- Ludger Wibbeke
 - (zugleich Aufsichtsratsvorsitzender der HANSAINVEST LUX S.A. und Aufsichtsratsvorsitzender der WohnSelect Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH)

VERWAHRSTELLE

Donner & Reuschel AG
Ballindamm 27
20095 Hamburg

Haftendes Eigenkapital: 372,400 Mio. EUR
Eingezahltes Eigenkapital: 20,500 Mio. EUR
Stand: 31.12.2022

WIRTSCHAFTSPRÜFER

KPMG AG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Fuhrentwiete 5
20355 Hamburg
Deutschland

HANSAINVEST

Hanseatische Investment-GmbH

Ein Unternehmen der
SIGNAL IDUNA Gruppe

Kapstadtring 8
22297 Hamburg

Telefon 040 30057-6296

info@hansainvest.de
www.hansainvest.de

HANSAINVEST